

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 4 | 0 | 4 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

48

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 14,446 | 0 | 14,446 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S200224

998

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,172

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 7,308 | 0 | 7,308 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S200310

| |
|-----|
| 577 |
|-----|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|-----|
| 858 |
|-----|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

유로인덱스모(주식-파생형)

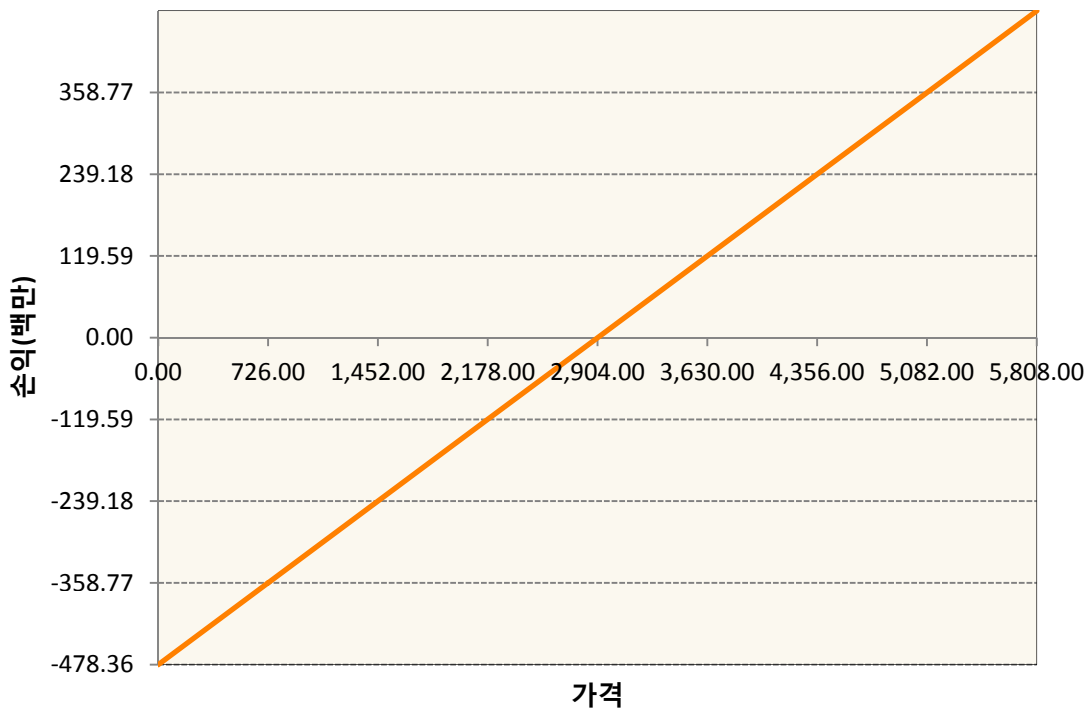
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 478 | 0 | 478 | |

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGM0 | EURO STOXX 50 Jun20 | 38 |
|------|---------------------|----|

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|----|
| 50 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

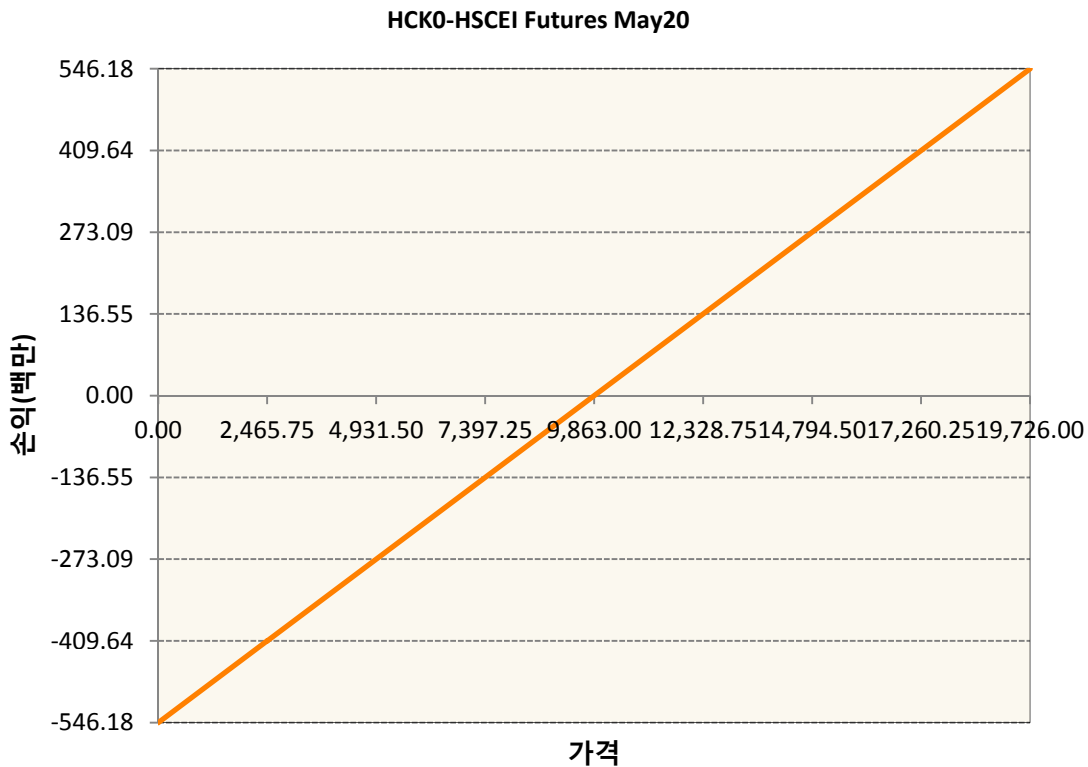
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 546 | 0 | 546 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| HCK0 | HSCEI Futures May20 | 44 |
|------|---------------------|----|

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|----|
| 47 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

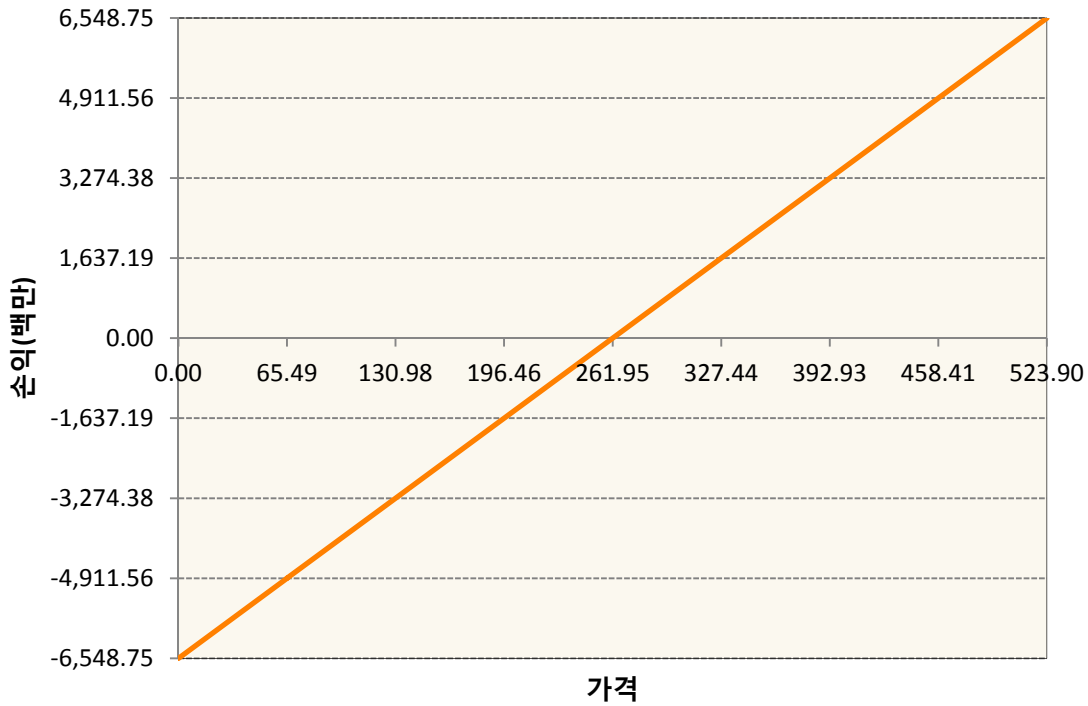
1. 계약금액

(단위:백만원)

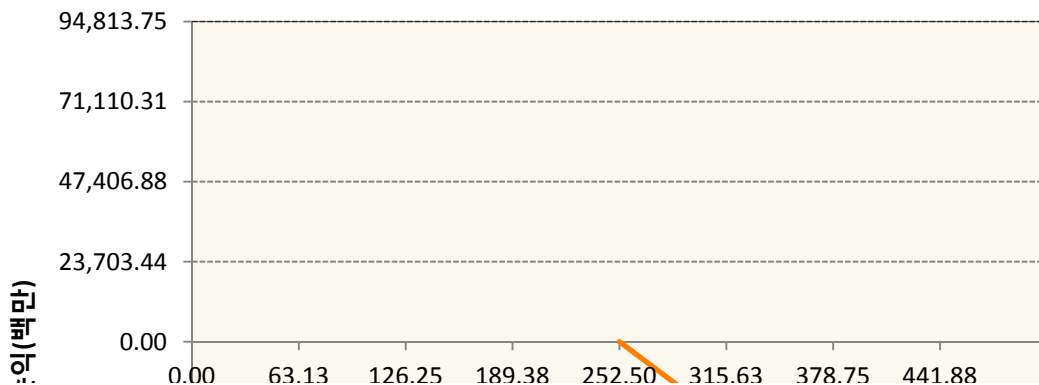
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,549 | 0 | 6,549 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 364,213 | -364,213 | 장내 |

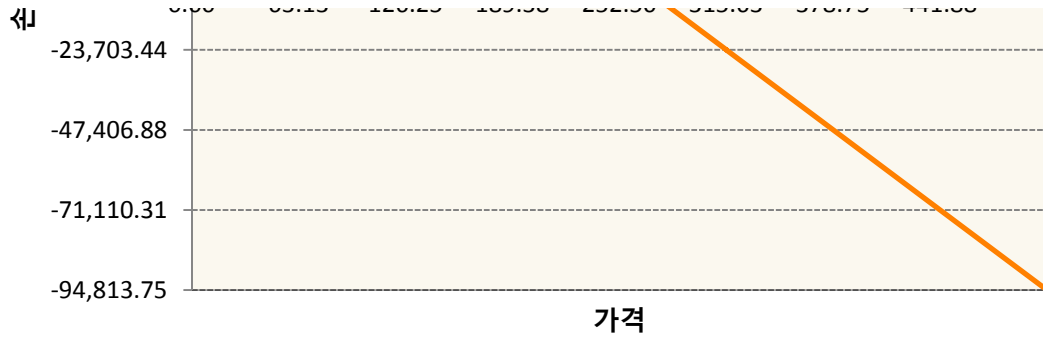
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

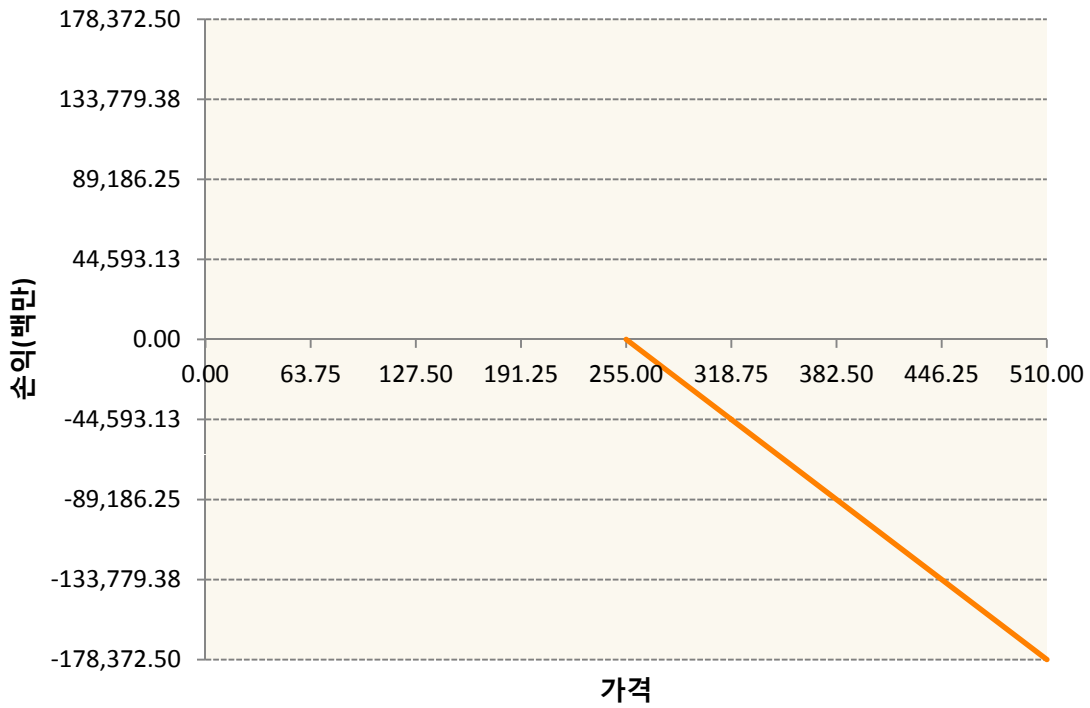


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

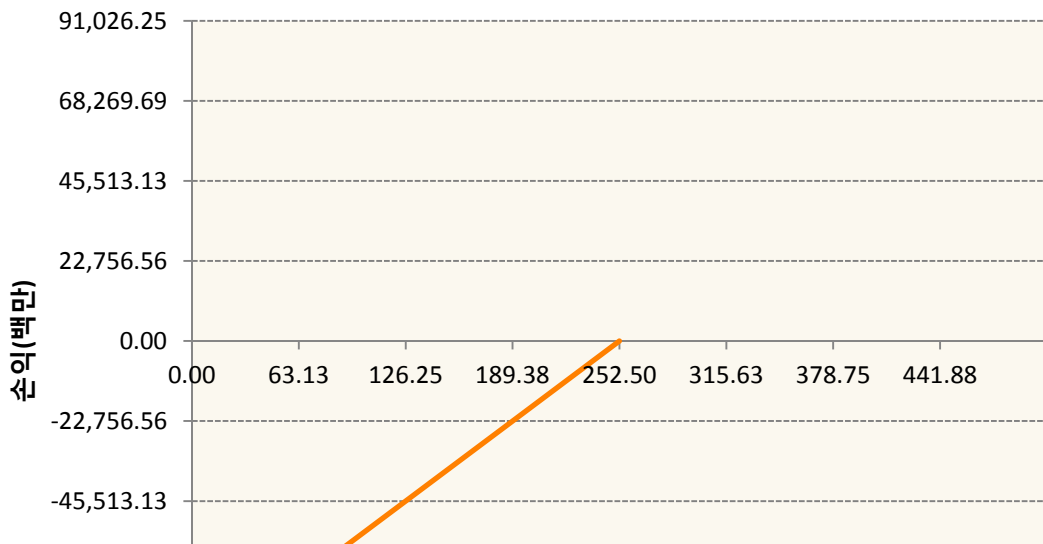


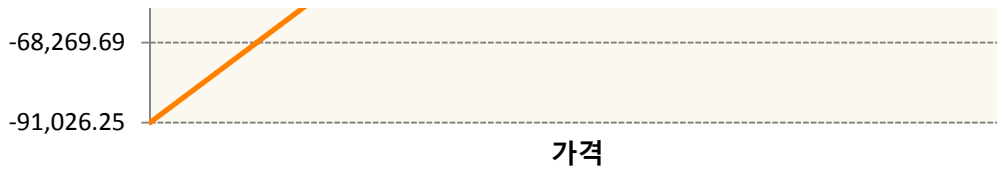


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 524 |
|--------------|---------|--------------------|---------|---------|---------|---------|---------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -524 | -524 | -524 | -524 | -524 | -524 | -524 | |
| -5.33% | -349 | -349 | -349 | -349 | -349 | -349 | -349 | |
| -2.67% | -175 | -175 | -175 | -175 | -175 | -175 | -175 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 175 | 175 | 175 | 175 | 175 | 175 | 175 | |
| 5.33% | 349 | 349 | 349 | 349 | 349 | 349 | 349 | |
| 8.00% | 524 | 524 | 524 | 524 | 524 | 524 | 524 | |
| KR4201Q62527 | | 2020-06 콜252.5 | | | | | | 6,710 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 4,835 | 4,541 | 4,238 | 3,930 | 3,617 | 3,300 | 2,980 | |
| -5.33% | 3,897 | 3,559 | 3,219 | 2,879 | 2,537 | 2,195 | 1,852 | |
| -2.67% | 2,617 | 2,267 | 1,917 | 1,566 | 1,216 | 865 | 514 | |
| 0% | 1,001 | 671 | 338 | 0 | -340 | -683 | -1,027 | |
| 2.67% | -914 | -1,197 | -1,493 | -1,799 | -2,113 | -2,433 | -2,758 | |
| 5.33% | -3,069 | -3,293 | -3,538 | -3,800 | -4,076 | -4,363 | -4,659 | |
| 8.00% | -5,400 | -5,565 | -5,756 | -5,969 | -6,201 | -6,449 | -6,710 | |
| KR4201Q62550 | | 2020-06 콜255 | | | | | | 12,198 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 8,418 | 7,903 | 7,368 | 6,817 | 6,253 | 5,679 | 5,097 | |
| -5.33% | 6,880 | 6,267 | 5,647 | 5,023 | 4,395 | 3,764 | 3,131 | |
| -2.67% | 4,724 | 4,065 | 3,407 | 2,749 | 2,092 | 1,434 | 777 | |
| 0% | 1,934 | 1,294 | 649 | 0 | -651 | -1,304 | -1,959 | |
| 2.67% | -1,437 | -2,007 | -2,594 | -3,196 | -3,808 | -4,428 | -5,056 | |
| 5.33% | -5,294 | -5,761 | -6,261 | -6,787 | -7,336 | -7,901 | -8,481 | |
| 8.00% | -9,522 | -9,876 | -10,275 | -10,713 | -11,183 | -11,679 | -12,198 | |
| KR4301Q62525 | | 2020-06 풋252.5 | | | | | | 4,413 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -3,502 | -3,634 | -3,776 | -3,927 | -4,084 | -4,246 | -4,413 | |
| -5.33% | -1,647 | -1,836 | -2,027 | -2,219 | -2,414 | -2,609 | -2,805 | |
| -2.67% | -302 | -505 | -708 | -911 | -1,115 | -1,318 | -1,522 | |

| | | | | | | | |
|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|------|
| 0% | 521 | 353 | 179 | 0 | -183 | -370 | -559 |
| 2.67% | 939 | 830 | 708 | 574 | 430 | 278 | 120 |
| 5.33% | 1,114 | 1,058 | 986 | 900 | 801 | 691 | 570 |
| 8.00% | 1,175 | 1,151 | 1,116 | 1,067 | 1,007 | 934 | 850 |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

21,577

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

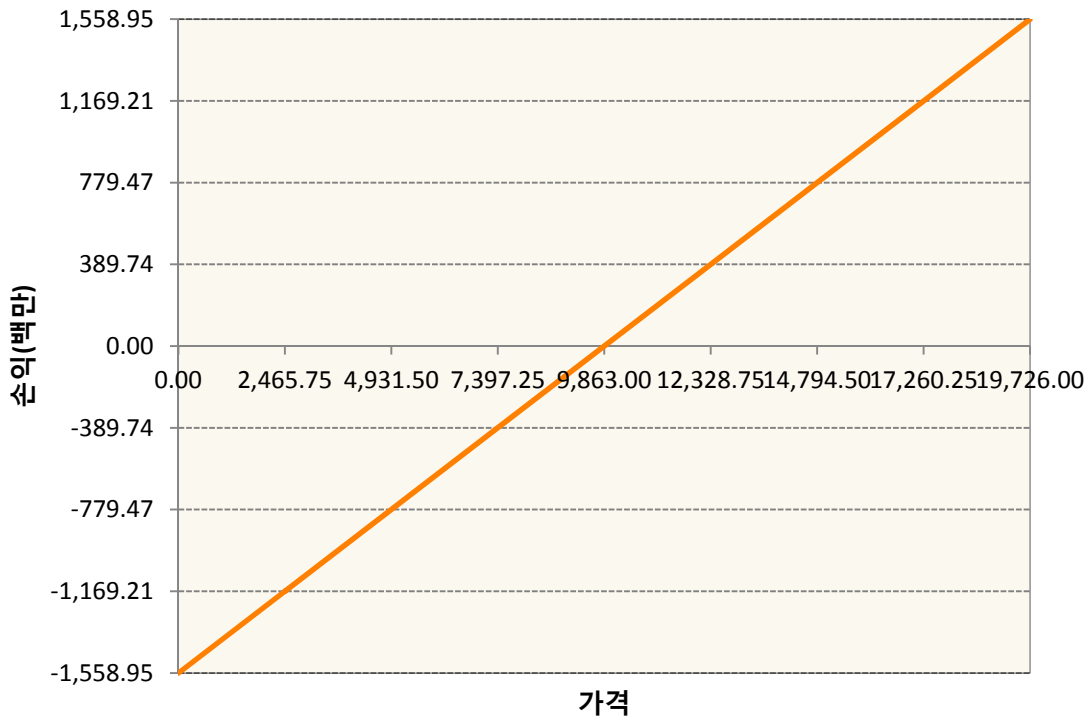
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,559 | 0 | 1,559 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 4,426 | -4,426 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 696 | 2,226 | -1,530 | 장외 |

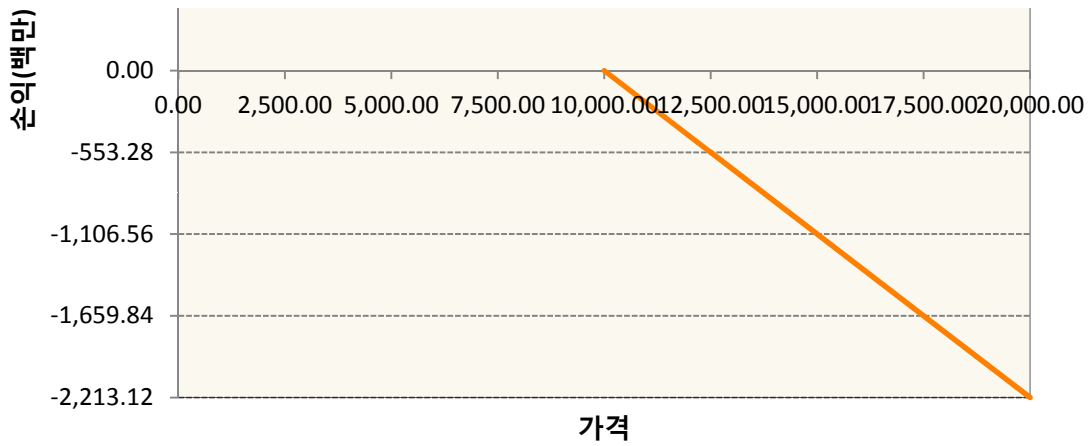
2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20

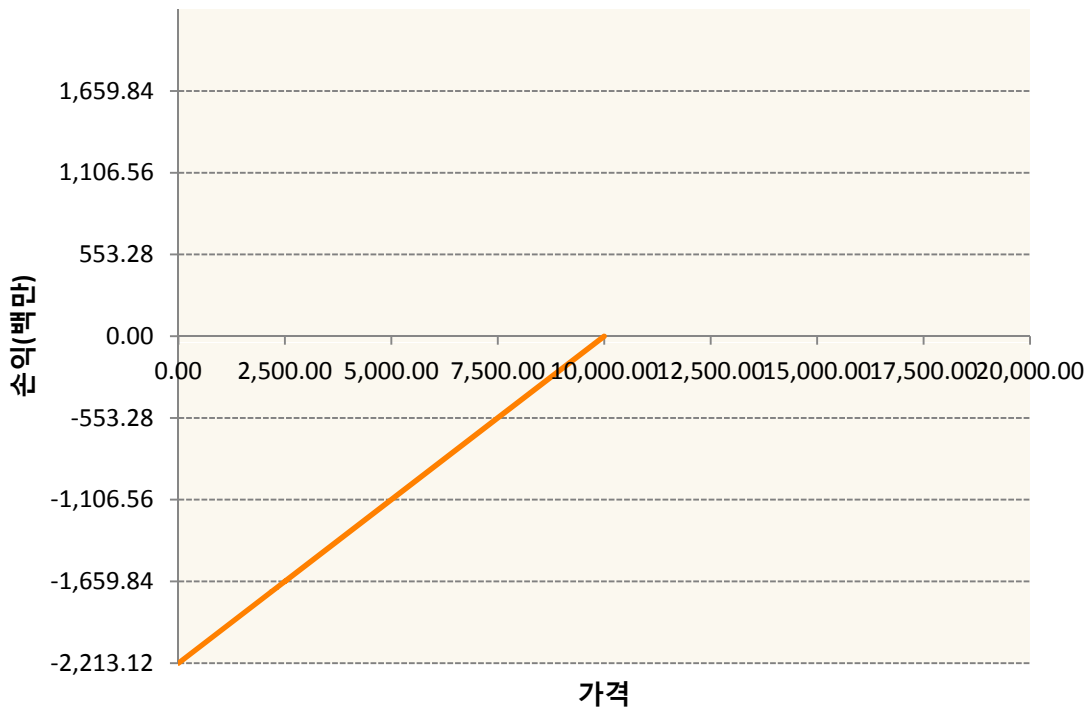


OHHIK0-C100-HSCEI





OHHIK0-P100-HSCEI



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|------------------------------|-----|
| FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E | 178 |
| FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E | 56 |
| HCK0 HSCEI Futures May20 | 125 |
| OHHIK0-C1C HSCEI | 177 |
| OHHIK0-P10 HSCEI | 177 |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|-----|
| 635 |
|-----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

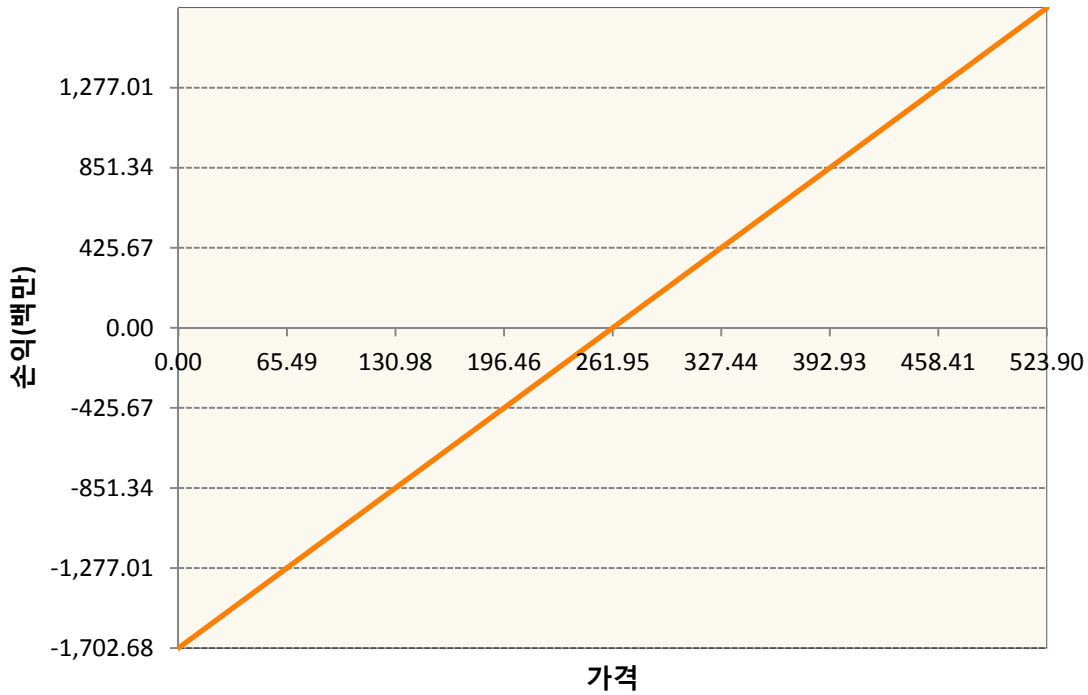
1. 계약금액

(단위:백만원)

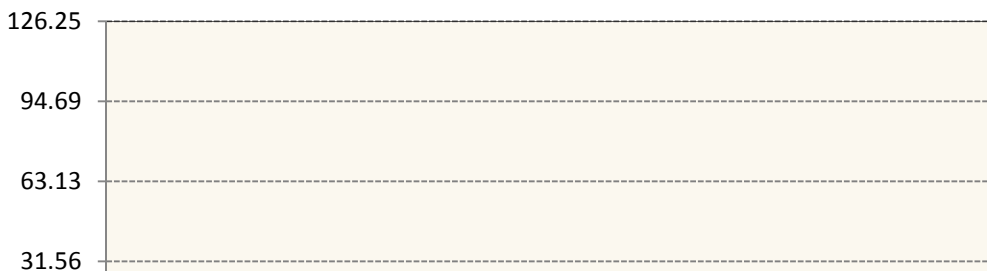
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,703 | 0 | 1,703 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 2,125 | 0 | 2,125 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 3,361 | -3,361 | 장내 |

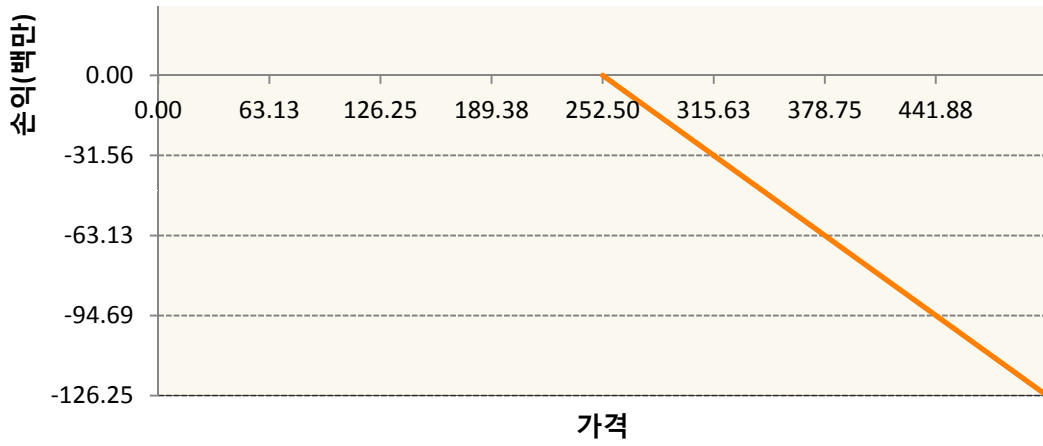
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

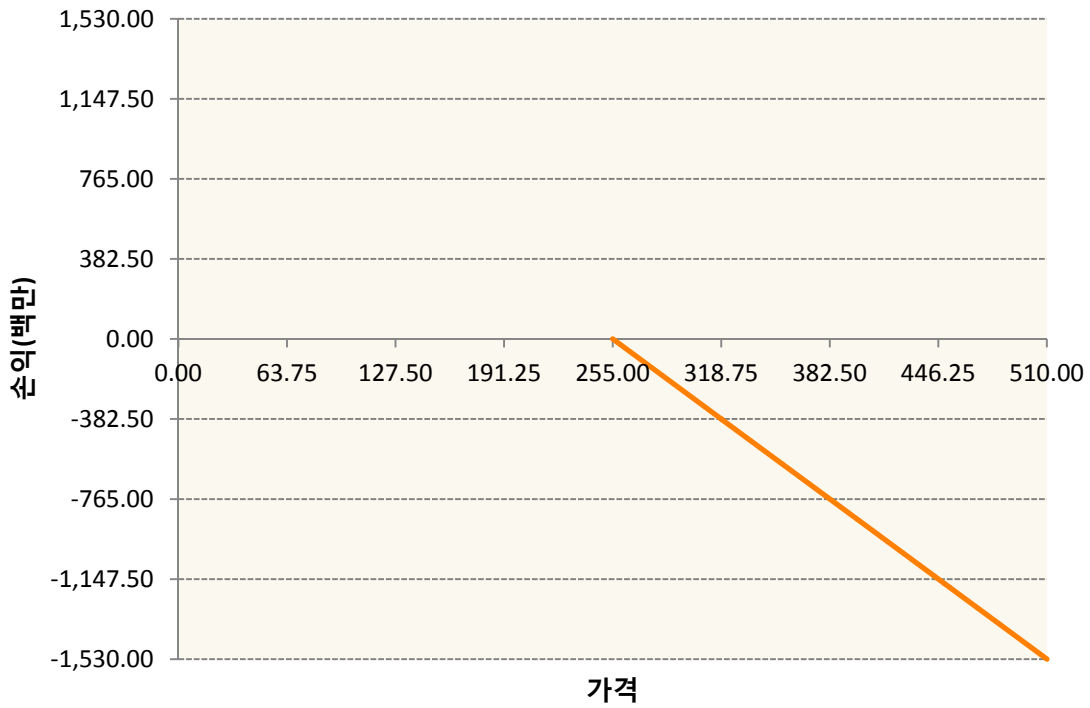


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

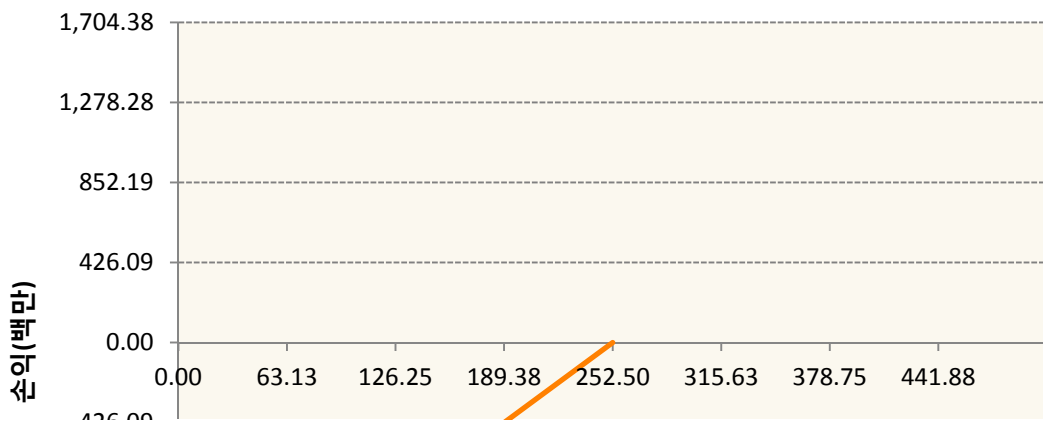




KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_16 | | | | | | 190 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -190 | -190 | -190 | -190 | -190 | -190 | -190 | |
| -5.33% | -126 | -126 | -126 | -126 | -126 | -126 | -126 | |
| -2.67% | -63 | -63 | -63 | -63 | -63 | -63 | -63 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 63 | 63 | 63 | 63 | 63 | 63 | 63 | |
| 5.33% | 126 | 126 | 126 | 126 | 126 | 126 | 126 | |
| 8.00% | 190 | 190 | 190 | 190 | 190 | 190 | 190 | |
| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 136 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -136 | -136 | -136 | -136 | -136 | -136 | -136 | |
| -5.33% | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 | |
| -2.67% | -45 | -45 | -45 | -45 | -45 | -45 | -45 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 | |
| 5.33% | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | |
| 8.00% | 136 | 136 | 136 | 136 | 136 | 136 | 136 | |
| KR4201Q62527 | | 2020-06 콜252.5 | | | | | | 9 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 6 | 6 | 6 | 5 | 5 | 4 | 4 | |
| -5.33% | 5 | 5 | 4 | 4 | 3 | 3 | 2 | |
| -2.67% | 3 | 3 | 3 | 2 | 2 | 1 | 1 | |
| 0% | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | -1 | -1 | |
| 2.67% | -1 | -2 | -2 | -2 | -3 | -3 | -4 | |
| 5.33% | -4 | -4 | -5 | -5 | -5 | -6 | -6 | |
| 8.00% | -7 | -7 | -8 | -8 | -8 | -9 | -9 | |
| KR4201Q62550 | | 2020-06 콜255 | | | | | | 105 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| -8.00% | 72 | 68 | 63 | 58 | 54 | 49 | 44 |
| -5.33% | 59 | 54 | 48 | 43 | 38 | 32 | 27 |
| -2.67% | 41 | 35 | 29 | 24 | 18 | 12 | 7 |
| 0% | 17 | 11 | 6 | 0 | -6 | -11 | -17 |
| 2.67% | -12 | -17 | -22 | -27 | -33 | -38 | -43 |
| 5.33% | -45 | -49 | -54 | -58 | -63 | -68 | -73 |
| 8.00% | -82 | -85 | -88 | -92 | -96 | -100 | -105 |
| KR4301Q62525 2020-06 풋252.5 | | | | | | | 83 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -66 | -68 | -71 | -74 | -76 | -80 | -83 |
| -5.33% | -31 | -34 | -38 | -42 | -45 | -49 | -53 |
| -2.67% | -6 | -9 | -13 | -17 | -21 | -25 | -28 |
| 0% | 10 | 7 | 3 | 0 | -3 | -7 | -10 |
| 2.67% | 18 | 16 | 13 | 11 | 8 | 5 | 2 |
| 5.33% | 21 | 20 | 18 | 17 | 15 | 13 | 11 |
| 8.00% | 22 | 22 | 21 | 20 | 19 | 17 | 16 |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

564

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

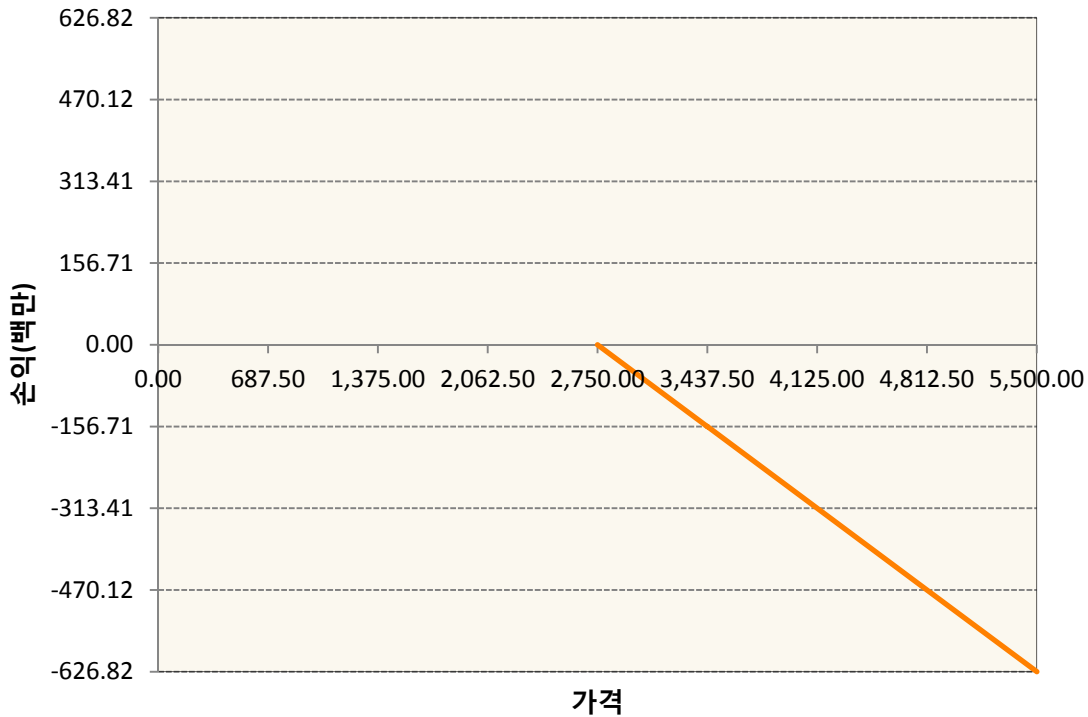
1. 계약금액

(단위:백만원)

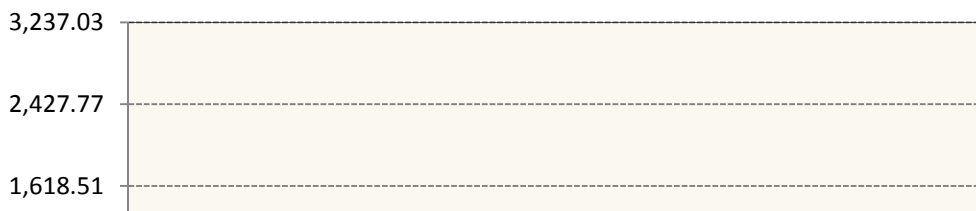
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,752 | 0 | 1,752 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 7,997 | 0 | 7,997 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 7,728 | -7,728 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 2,901 | -2,901 | 장외 |

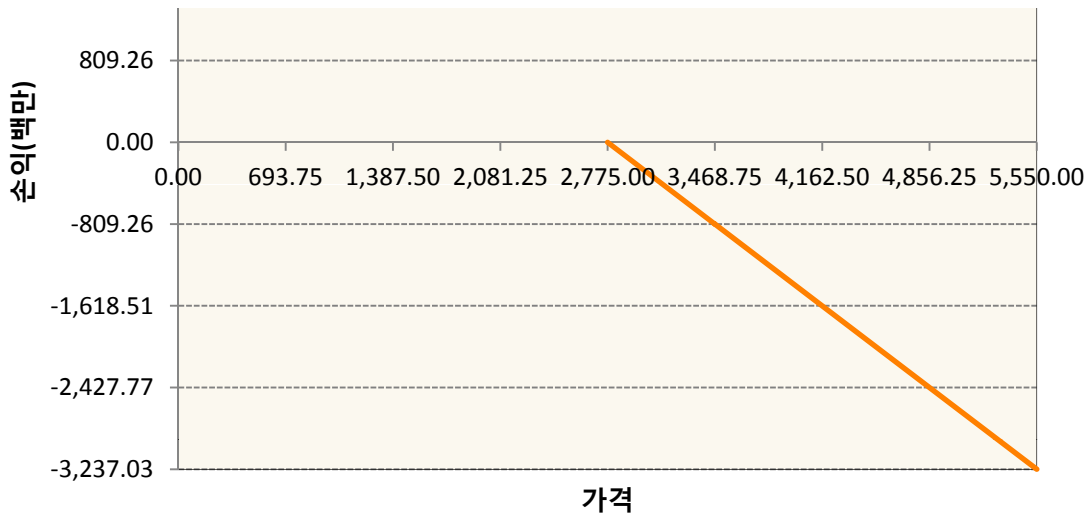
2. 만기시점의 손익구조

OESXM0-C2750-EURO STOXX 50

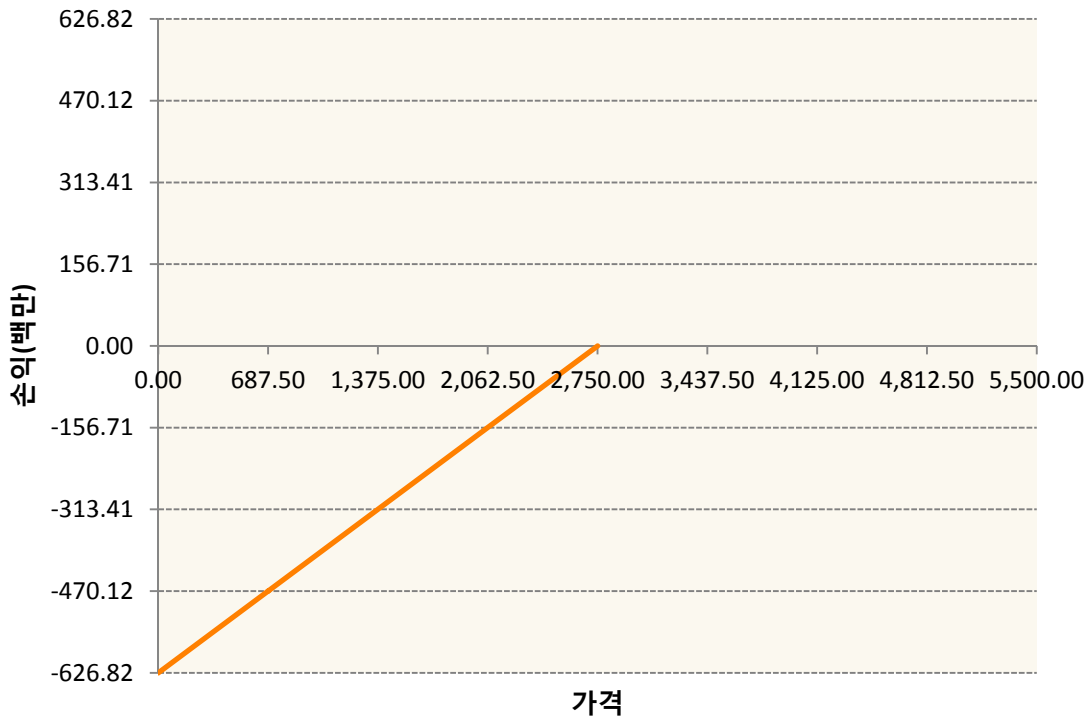


OESXM0-C2775-EURO STOXX 50

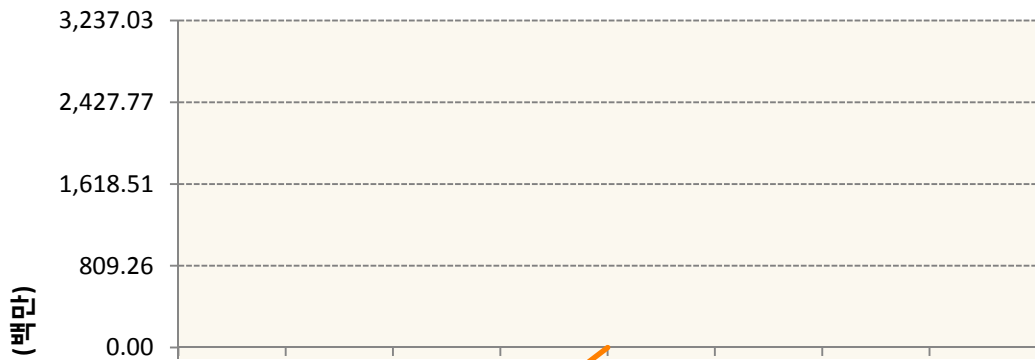


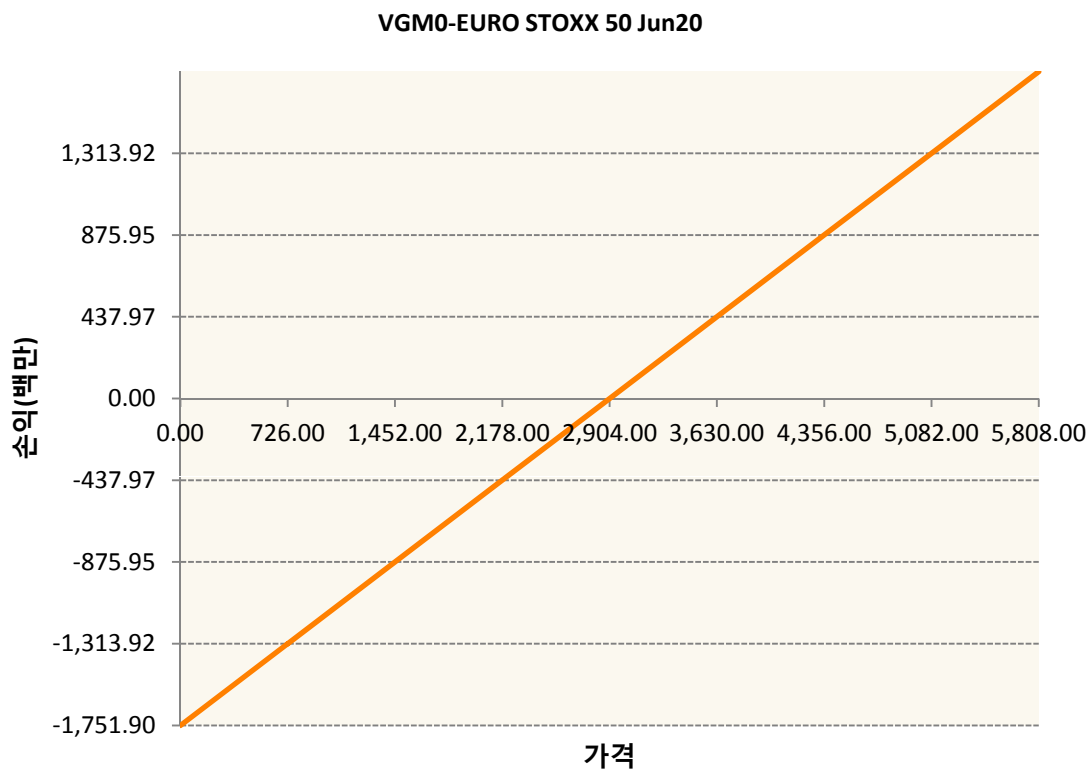
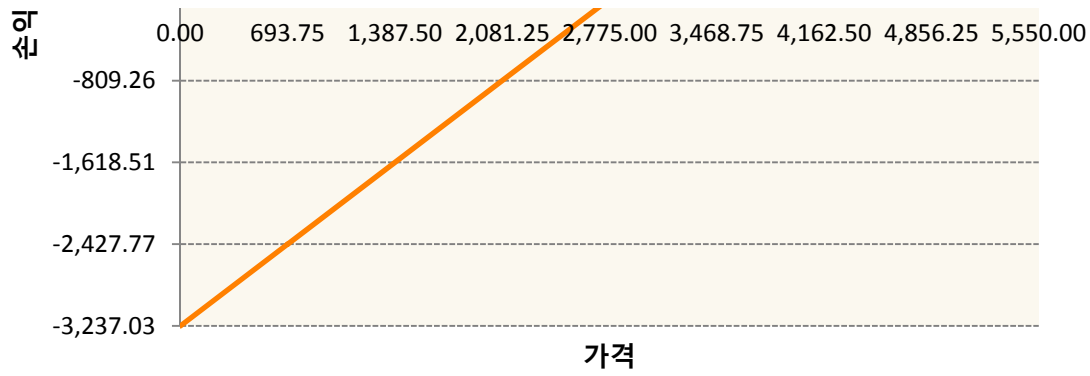


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



OESXM0-P2775-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---------------------|----------|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | | 14 |
| FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E | | 217 |
| FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E | | 15 |
| OESXM0-C2' EURO STOXX 50 | | 50 |
| OESXM0-C2' EURO STOXX 50 | | 259 |
| OESXM0-P2' EURO STOXX 50 | | 50 |
| OESXM0-P2' EURO STOXX 50 | | 259 |
| VGM0 | EURO STOXX 50 Jun20 | 140 |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,145

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,169

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

ETF스마트레버리지목표전환형9호

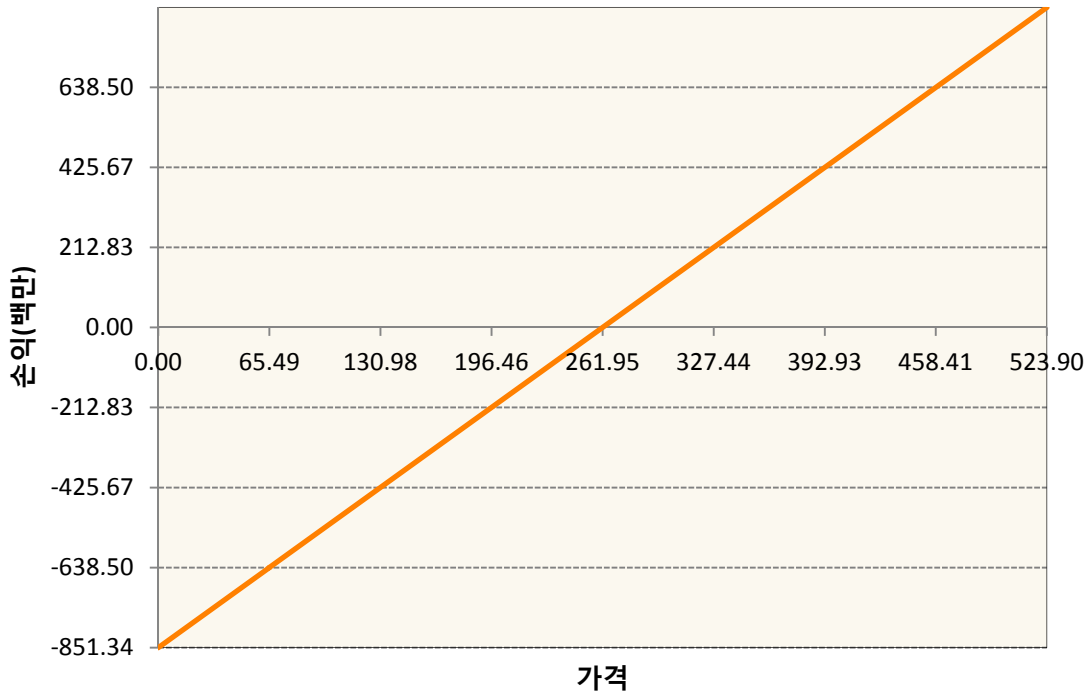
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 851 | 0 | 851 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 68 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -68 | -68 | -68 | -68 | -68 | -68 | -68 | |
| -5.33% | -45 | -45 | -45 | -45 | -45 | -45 | -45 | |
| -2.67% | -23 | -23 | -23 | -23 | -23 | -23 | -23 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 | |
| 5.33% | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 | |
| 8.00% | 68 | 68 | 68 | 68 | 68 | 68 | 68 | |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

101

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

ETF스마트레버리지목표전환형10호

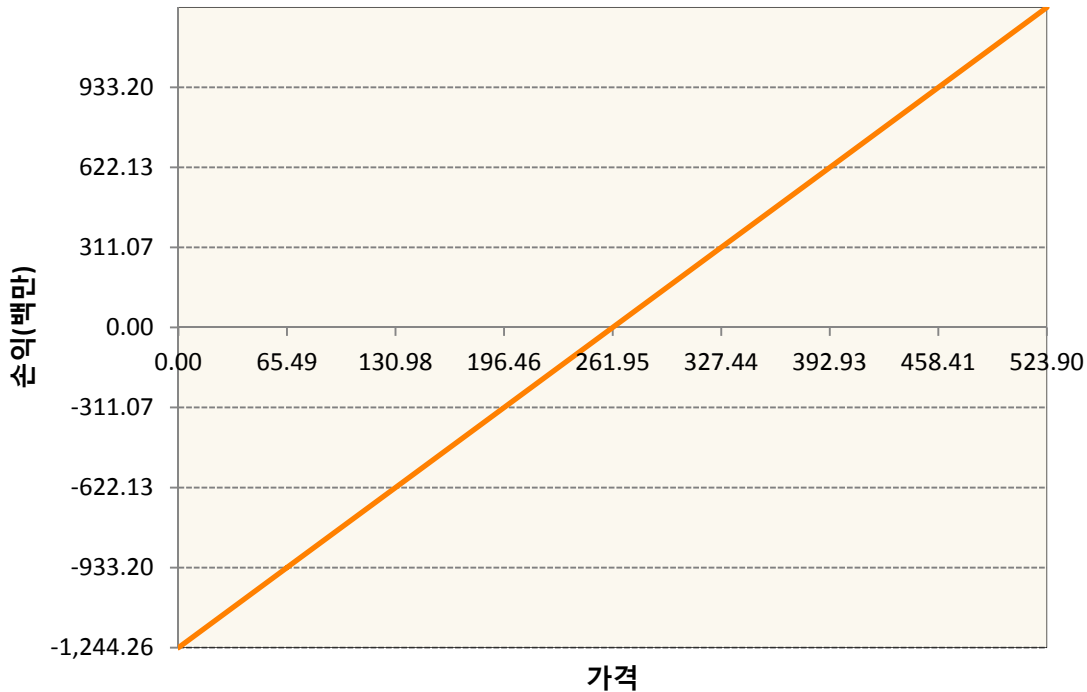
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,244 | 0 | 1,244 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002 2020-06 코스피200지수선물 99

| 가격 | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -99 | -99 | -99 | -99 | -99 | -99 | -99 |
| -5.33% | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 |
| -2.67% | -33 | -33 | -33 | -33 | -33 | -33 | -33 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 33 | 33 | 33 | 33 | 33 | 33 | 33 |
| 5.33% | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 |
| 8.00% | 99 | 99 | 99 | 99 | 99 | 99 | 99 |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

148

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

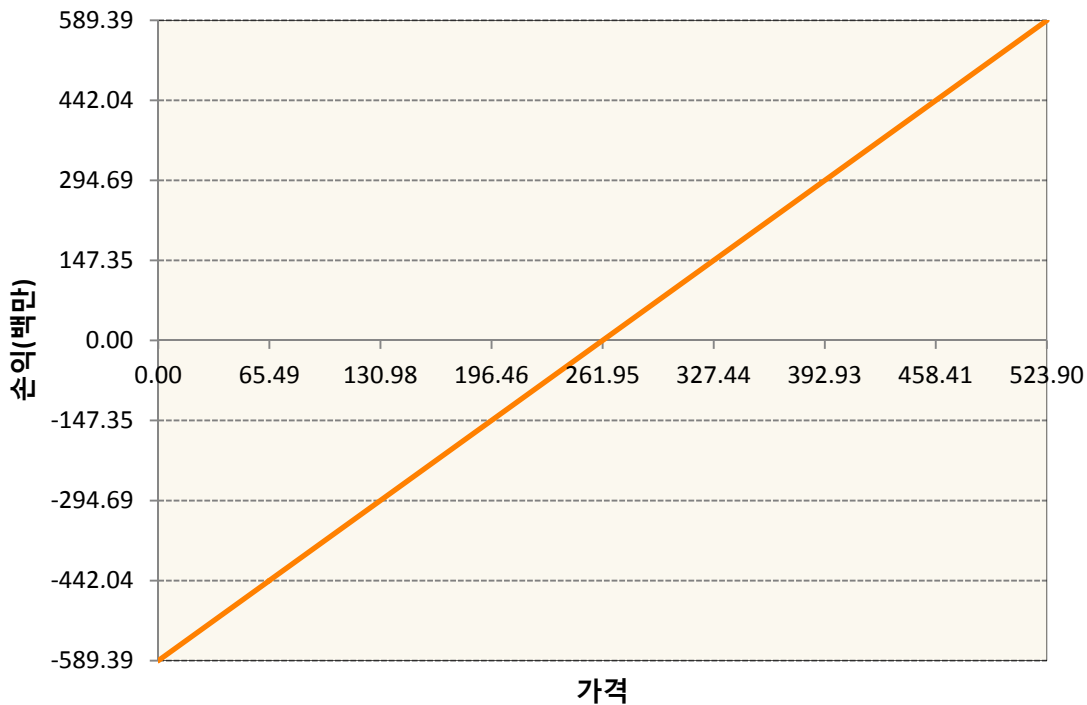
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 589 | 0 | 589 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 47 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 | |
| -5.33% | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 | |
| -2.67% | -16 | -16 | -16 | -16 | -16 | -16 | -16 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 16 | 16 | 16 | 16 | 16 | 16 | 16 | |
| 5.33% | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | |
| 8.00% | 47 | 47 | 47 | 47 | 47 | 47 | 47 | |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

70

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

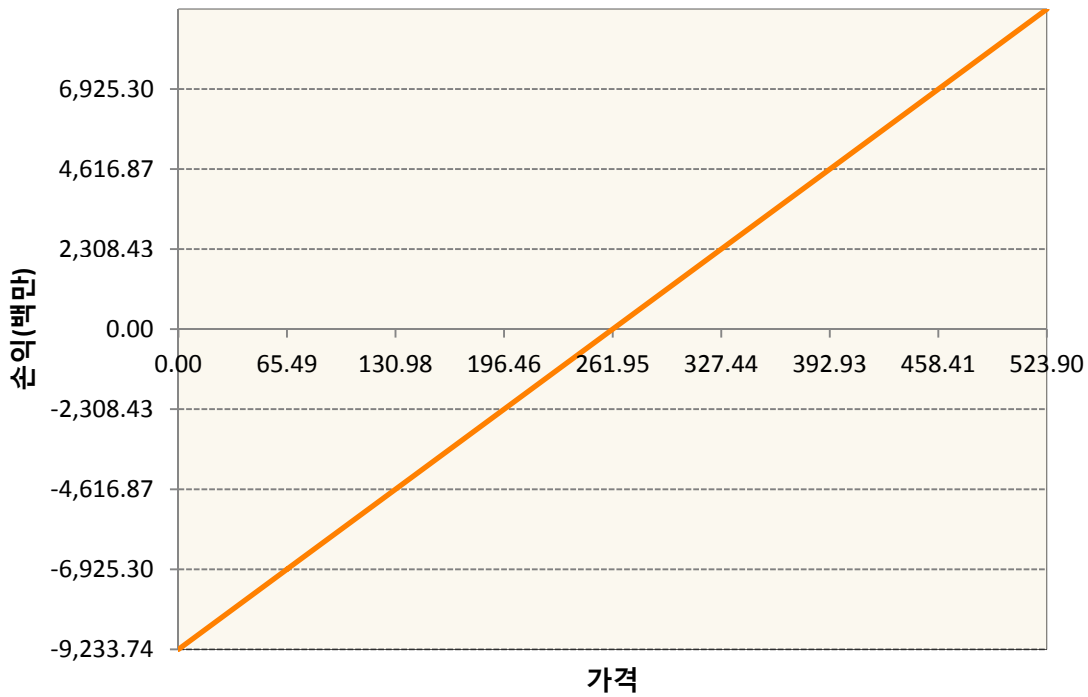
1. 계약금액

(단위:백만원)

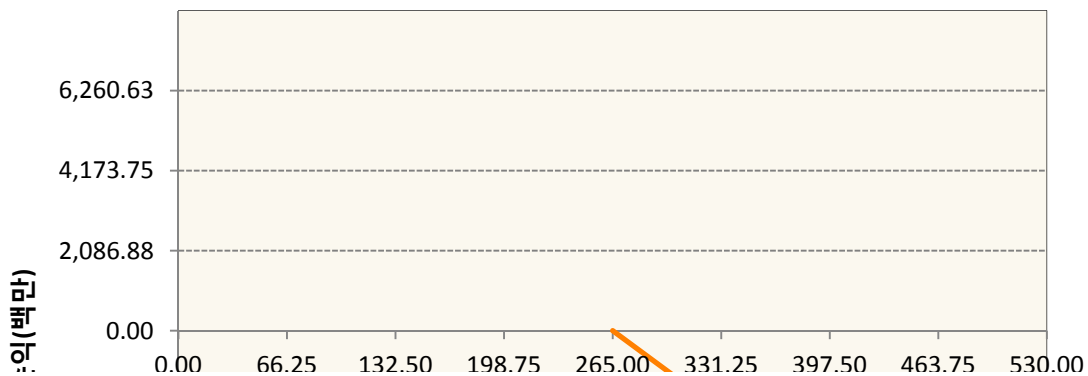
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 9,234 | 0 | 9,234 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 2,917 | 17,911 | -14,994 | 장내 |

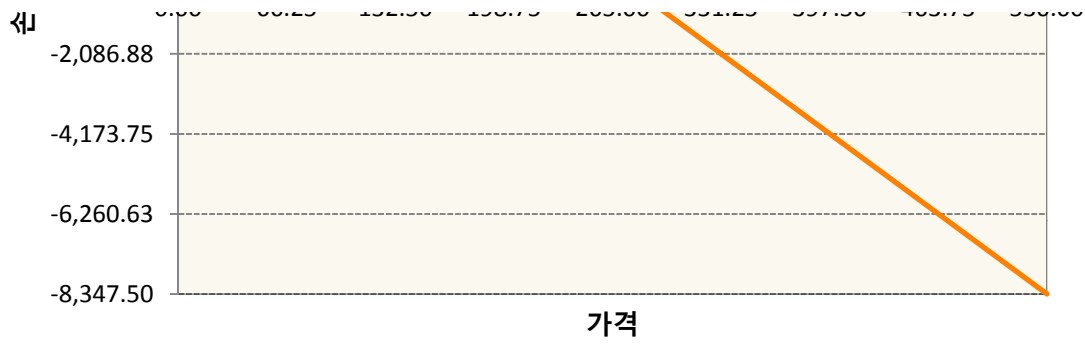
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

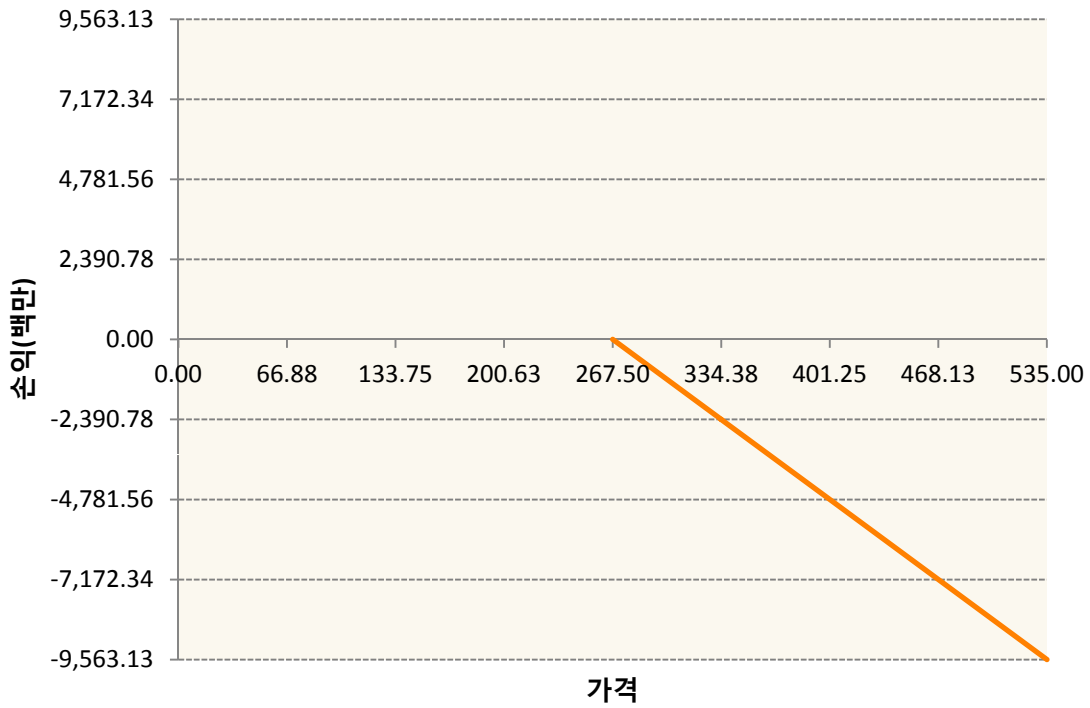


KR4201Q62659-2020-06 콜265

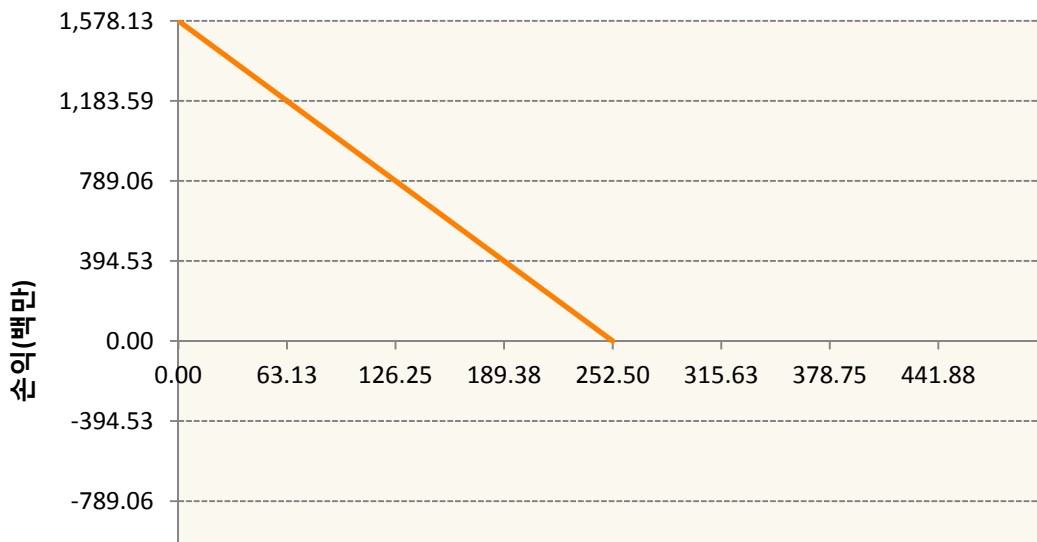


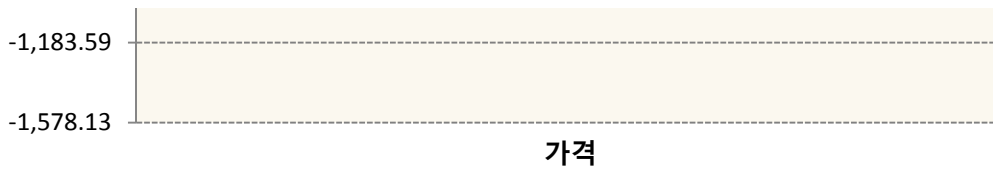


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5

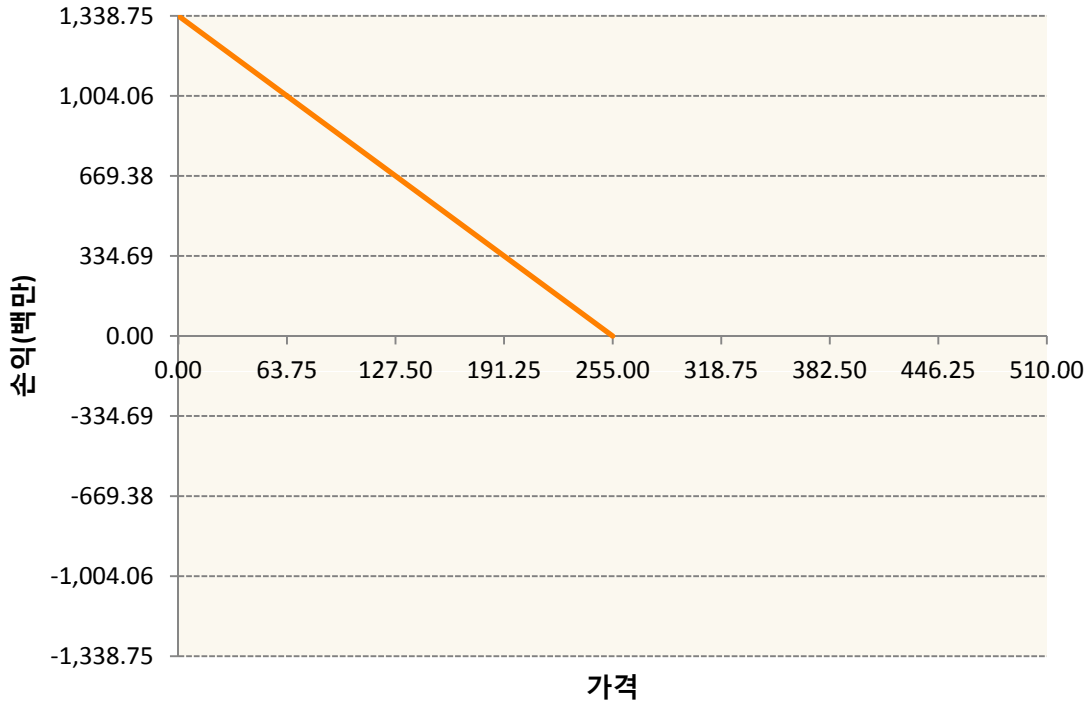


KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





KR4301Q62558-2020-06 풋255



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 738 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -738 | -738 | -738 | -738 | -738 | -738 | -738 | |
| -5.33% | -492 | -492 | -492 | -492 | -492 | -492 | -492 | |
| -2.67% | -246 | -246 | -246 | -246 | -246 | -246 | -246 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 246 | 246 | 246 | 246 | 246 | 246 | 246 | |
| 5.33% | 492 | 492 | 492 | 492 | 492 | 492 | 492 | |
| 8.00% | 738 | 738 | 738 | 738 | 738 | 738 | 738 | |
| KR4201Q62659 | | 2020-06 콜265 | | | | | | 486 |
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 275 | 259 | 241 | 221 | 201 | 179 | 156 | |
| -5.33% | 237 | 215 | 191 | 167 | 142 | 116 | 90 | |
| -2.67% | 177 | 150 | 122 | 94 | 65 | 37 | 8 | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 0% | 91 | 61 | 30 | 0 | -30 | -61 | -91 |
| 2.67% | -22 | -53 | -84 | -115 | -145 | -176 | -207 |
| 5.33% | -162 | -191 | -220 | -249 | -279 | -309 | -339 |
| 8.00% | -325 | -350 | -376 | -402 | -430 | -458 | -486 |
| KR4201Q62675 2020-06 콜267.5 | | | | | | | 531 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 284 | 268 | 250 | 229 | 207 | 184 | 159 |
| -5.33% | 248 | 225 | 200 | 174 | 147 | 119 | 90 |
| -2.67% | 189 | 159 | 129 | 98 | 67 | 35 | 3 |
| 0% | 102 | 68 | 34 | 0 | -34 | -69 | -103 |
| 2.67% | -16 | -51 | -86 | -122 | -157 | -192 | -228 |
| 5.33% | -164 | -198 | -232 | -266 | -301 | -336 | -371 |
| 8.00% | -340 | -370 | -401 | -433 | -465 | -498 | -531 |
| KR4301Q62525 2020-06 풋252.5 | | | | | | | 77 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 61 | 63 | 65 | 68 | 71 | 74 | 77 |
| -5.33% | 29 | 32 | 35 | 38 | 42 | 45 | 49 |
| -2.67% | 5 | 9 | 12 | 16 | 19 | 23 | 26 |
| 0% | -9 | -6 | -3 | 0 | 3 | 6 | 10 |
| 2.67% | -16 | -14 | -12 | -10 | -7 | -5 | -2 |
| 5.33% | -19 | -18 | -17 | -16 | -14 | -12 | -10 |
| 8.00% | -20 | -20 | -19 | -19 | -17 | -16 | -15 |
| KR4301Q62558 2020-06 풋255 | | | | | | | 70 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 58 | 59 | 61 | 63 | 65 | 67 | 70 |
| -5.33% | 29 | 31 | 34 | 36 | 39 | 42 | 45 |
| -2.67% | 6 | 9 | 12 | 15 | 18 | 21 | 24 |
| 0% | -8 | -6 | -3 | 0 | 3 | 6 | 9 |
| 2.67% | -16 | -14 | -12 | -10 | -8 | -5 | -3 |
| 5.33% | -20 | -19 | -18 | -16 | -14 | -12 | -10 |
| 8.00% | -21 | -21 | -20 | -19 | -18 | -17 | -15 |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

2,019

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 148,133 | 0 | 148,133 | |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 99,878 | 0 | 99,878 | |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 441,273 | 0 | 441,273 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 427,140 | -427,140 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|-------------------------------|-------|
| FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E | 843 |
| FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E | 735 |
| FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E | 490 |
| FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E | 3,431 |
| FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E | 6,960 |
| FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E | 2,941 |
| FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E | 1,333 |
| FX21020J02£ KRW/USD 22-06-20E | 1,510 |
| FX21020J02¥ KRW/USD 22-06-20E | 1,960 |
| FX21020J03¥ KRW/USD 24-07-20E | 2,206 |
| FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E | 1,764 |
| FX21020J04£ KRW/USD 24-07-20E | 1,960 |
| FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E | 2,039 |
| FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E | 1,941 |
| FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E | 686 |
| FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E | 2,392 |
| FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E | 980 |

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

17,274

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

202

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

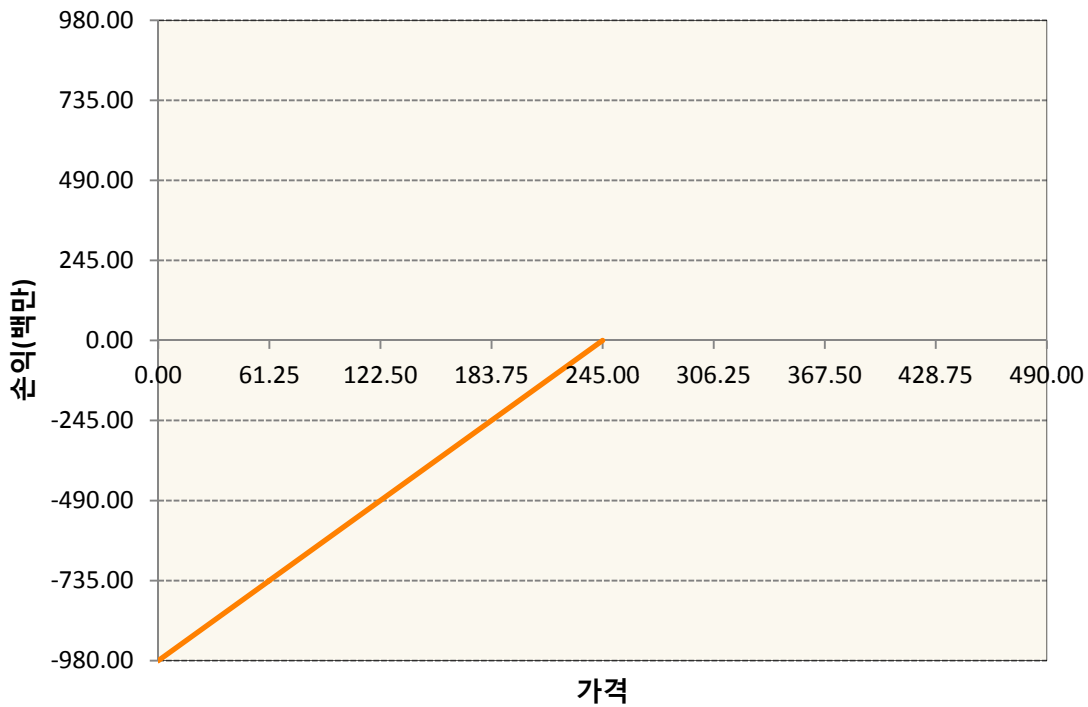
1. 계약금액

(단위:백만원)

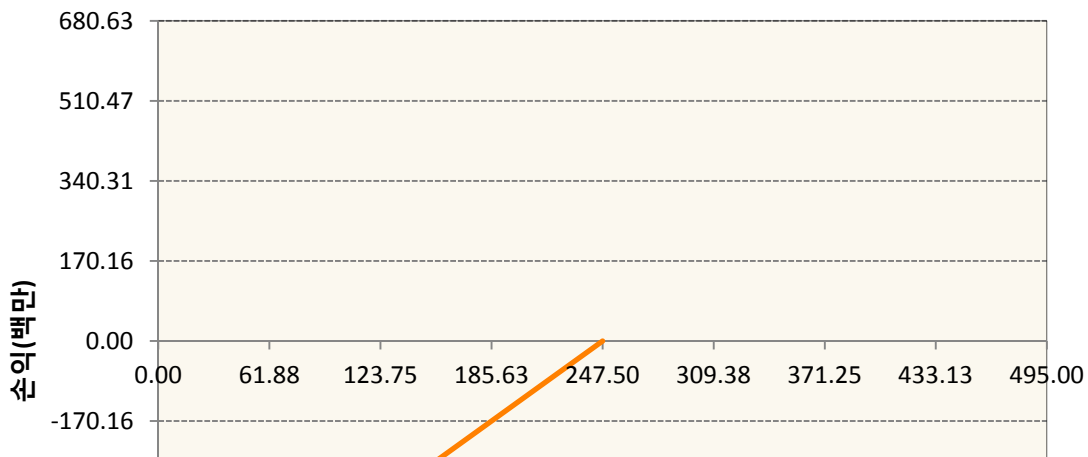
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 305 | 0 | 305 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 1,661 | -1,661 | 장내 |

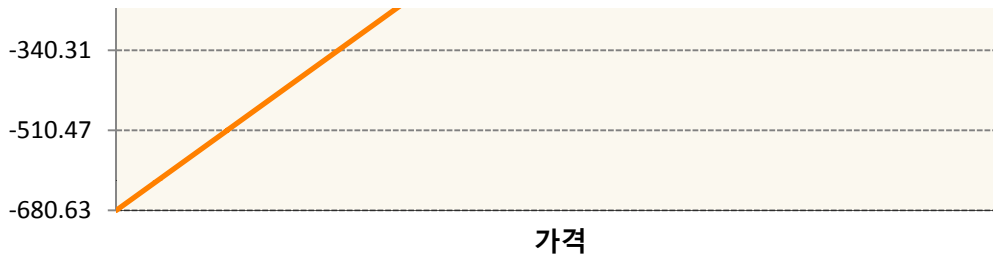
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q62459-2020-06 풋245



KR4301Q62475-2020-06 풋247.5





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | | | | | | | |
|--------------|-----------|----------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| KR4301Q62459 | | 2020-06 풋245 | | | | | | 36 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -24 | -26 | -28 | -30 | -32 | -34 | -36 | |
| -5.33% | -9 | -11 | -13 | -16 | -18 | -20 | -22 | |
| -2.67% | -1 | -2 | -4 | -6 | -8 | -10 | -12 | |
| 0% | 4 | 3 | 1 | 0 | -1 | -3 | -5 | |
| 2.67% | 5 | 5 | 4 | 3 | 2 | 1 | 0 | |
| 5.33% | 6 | 6 | 5 | 5 | 4 | 4 | 3 | |
| 8.00% | 6 | 6 | 6 | 6 | 5 | 5 | 4 | |
| KR4301Q62475 | | 2020-06 풋247.5 | | | | | | 28 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -20 | -21 | -22 | -24 | -25 | -26 | -28 | |
| -5.33% | -8 | -10 | -11 | -13 | -14 | -16 | -17 | |
| -2.67% | -1 | -2 | -4 | -5 | -6 | -8 | -9 | |
| 0% | 3 | 2 | 1 | 0 | -1 | -2 | -4 | |
| 2.67% | 5 | 4 | 4 | 3 | 2 | 1 | 0 | |
| 5.33% | 5 | 5 | 5 | 4 | 4 | 3 | 3 | |
| 8.00% | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | 4 | 4 | |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

47

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 7,274 | 0 | 7,274 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 7,168 | -7,168 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|------------------------------|-----|
| FX21020J04(KRW/USD 29-05-20E | 253 |
| FX21020K01(KRW/USD 15-06-20E | 321 |
| IE00BD8RGM75 | |

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

| |
|-----|
| 290 |
|-----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

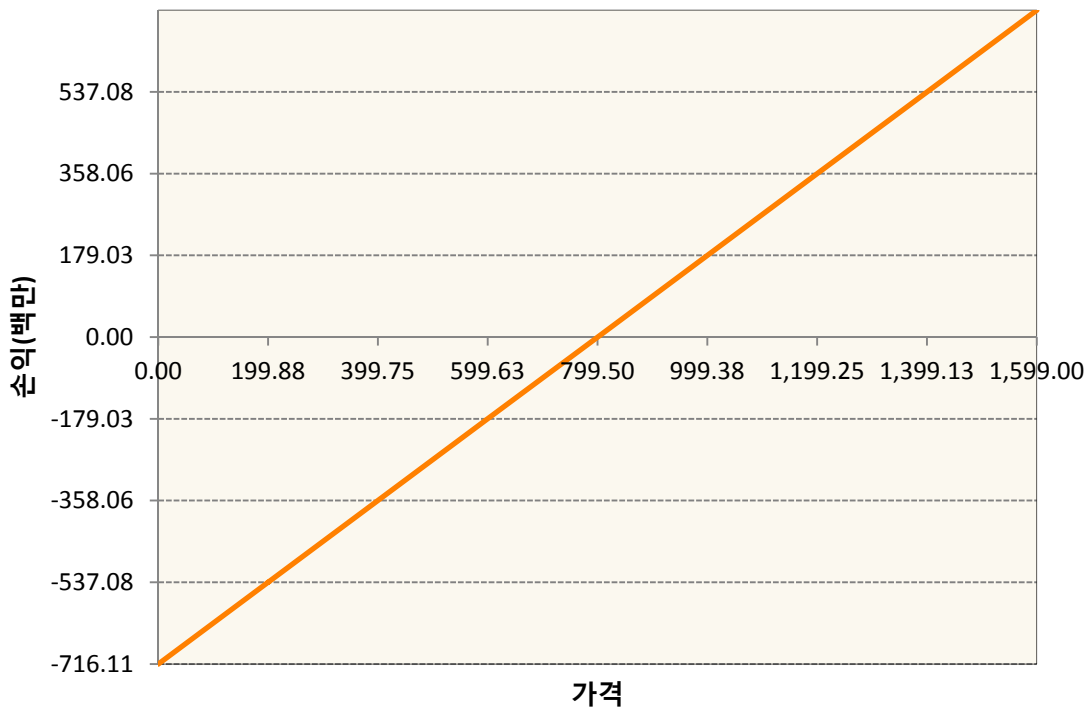
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 716 | 0 | 716 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 973 | 0 | 973 | 장외 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 206 | 877 | -670 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

VNCK0-VN30 Index Future May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|-------------------------------|----|
| 2.55E+11 VN30TR Index(EUR) | 78 |
| FX21020G01 KRW/EUR 22-05-20E | 5 |
| FX21020G05 KRW/EUR 26-06-20E | 12 |
| FX21020H09 EUR/KRW 26-06-20E | 8 |
| FX21020H11 EUR/KRW 26-06-20E | 9 |
| FX21020J00€ KRW/EUR 24-07-20E | 3 |

| | |
|-------------------------------|----|
| FX21020J009 KRW/EUR 24-07-20E | 5 |
| FX21020J018 KRW/EUR 24-07-20E | 3 |
| FX21020J029 KRW/EUR 24-07-20E | 5 |
| FX21020J033 KRW/EUR 26-06-20E | 5 |
| FX21020J038 KRW/EUR 24-07-20E | 1 |
| FX21020J048 KRW/EUR 22-05-20E | 11 |
| FX21020K00 KRW/EUR 22-05-20E | 5 |
| FX21020K00 KRW/EUR 24-07-20E | 5 |
| FX21020K01 KRW/EUR 24-07-20E | 9 |
| VNCK0 VN30 Index Future May20 | 57 |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

171

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

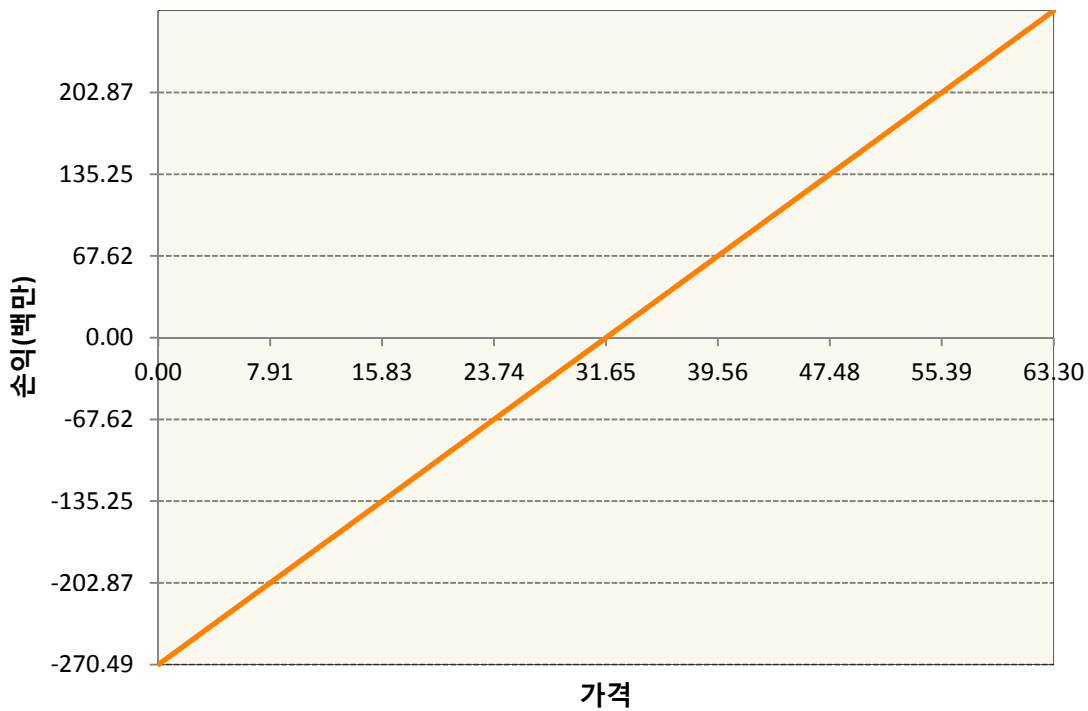
1. 계약금액

(단위:백만원)

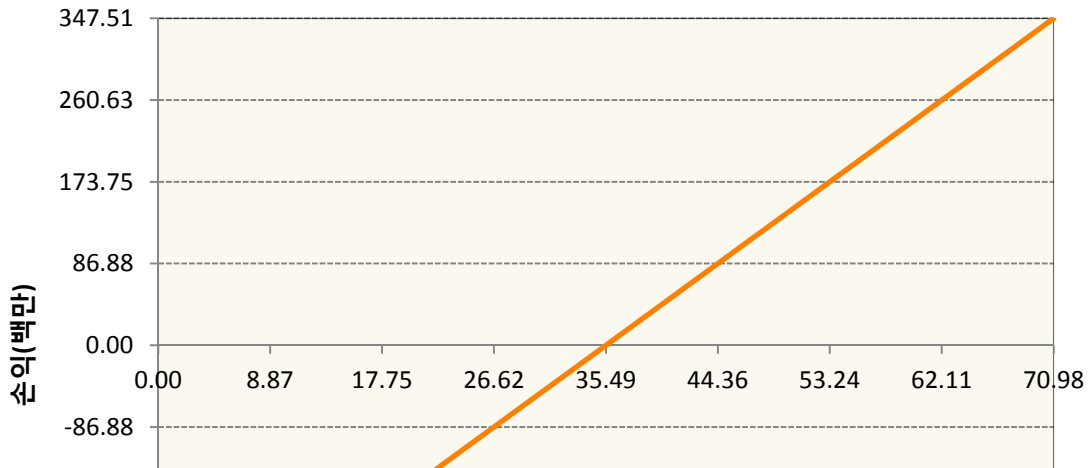
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,676 | 245 | 1,432 | |

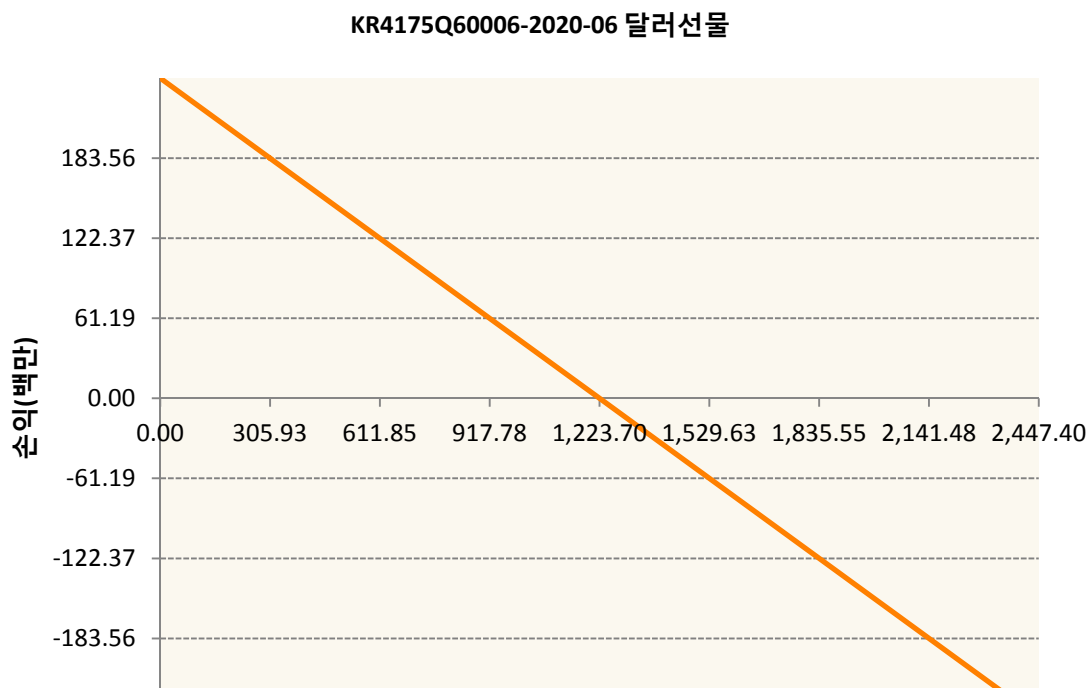
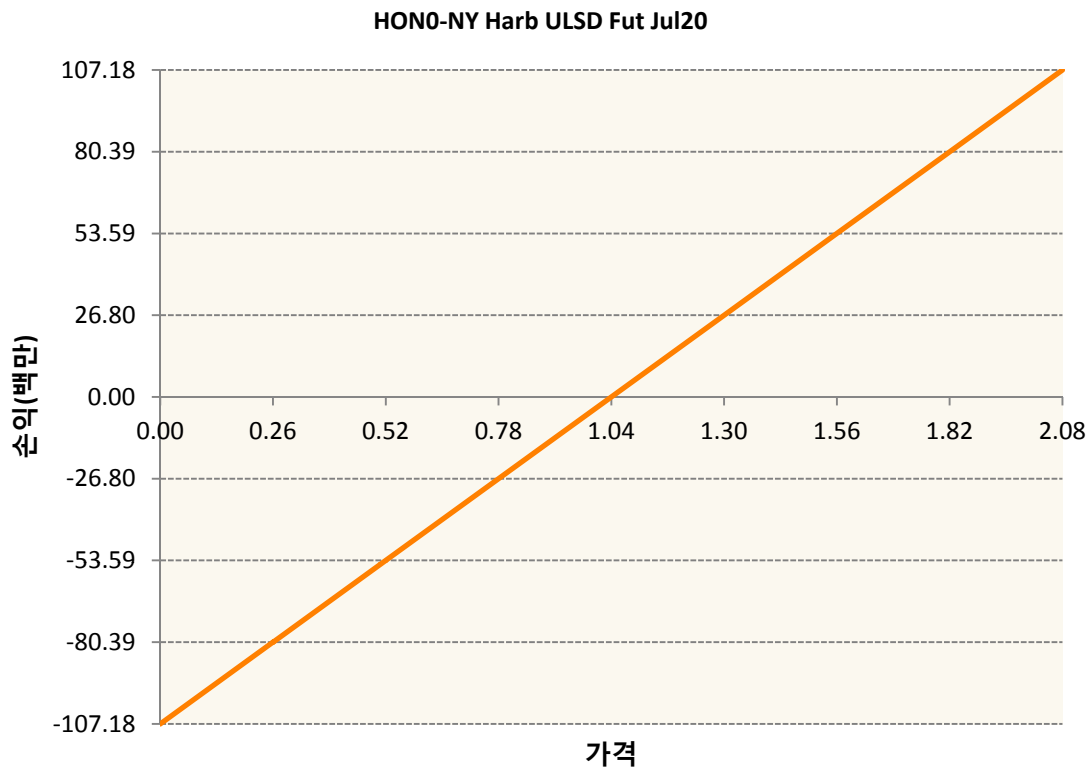
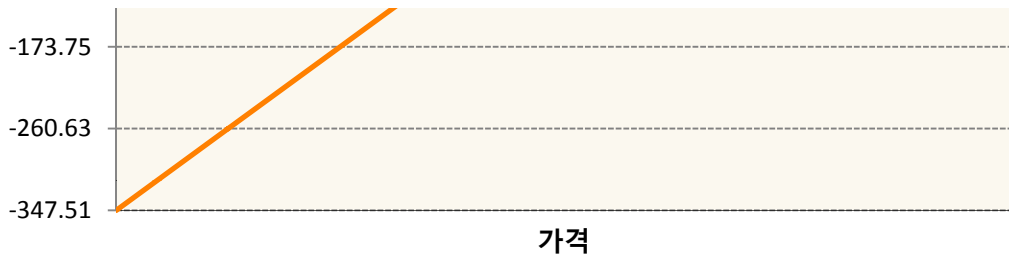
2. 만기시점의 손익구조

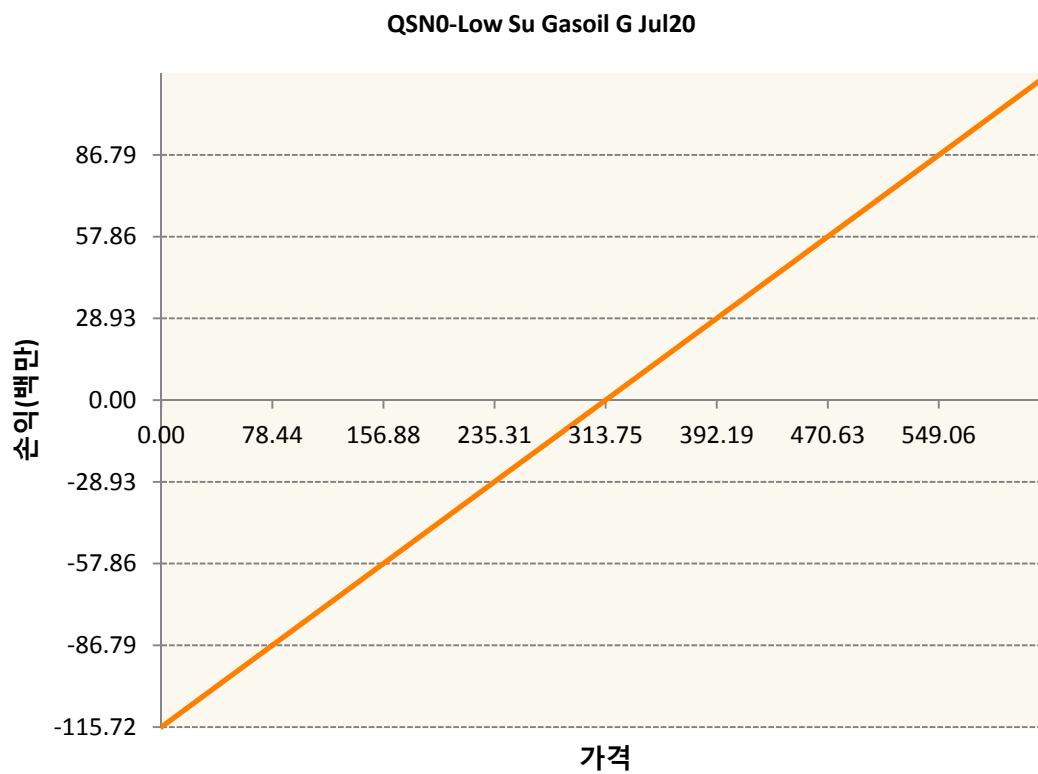
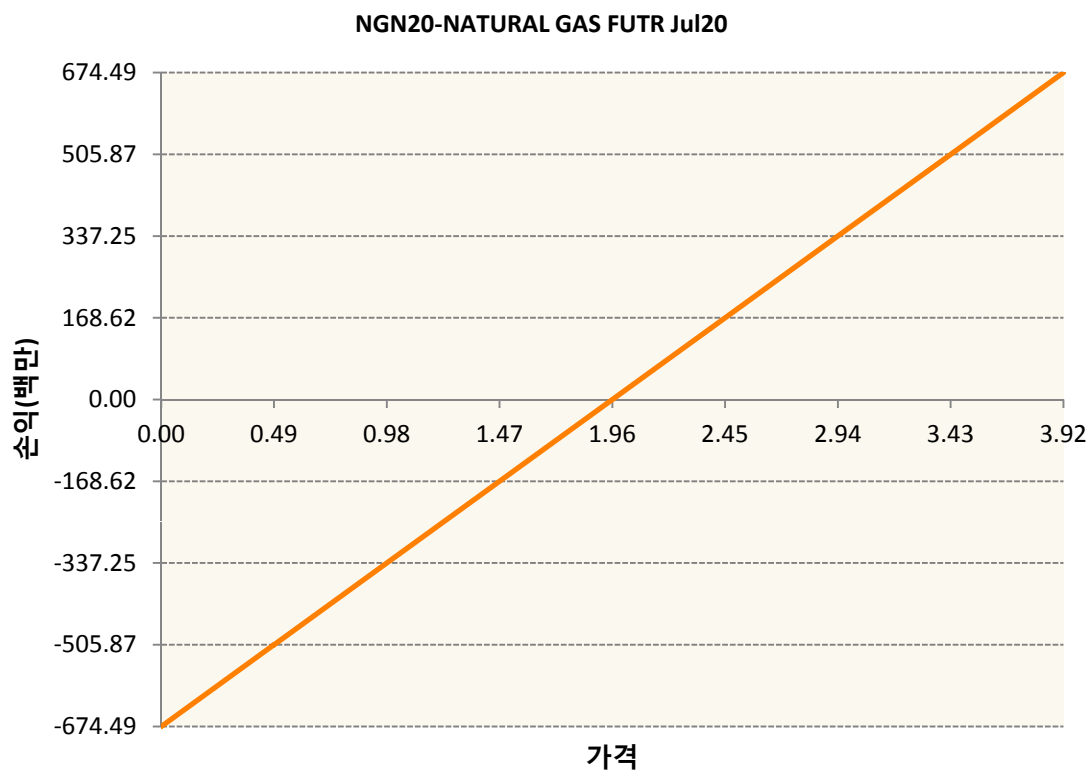
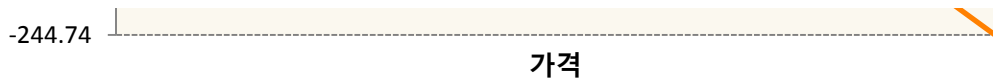
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



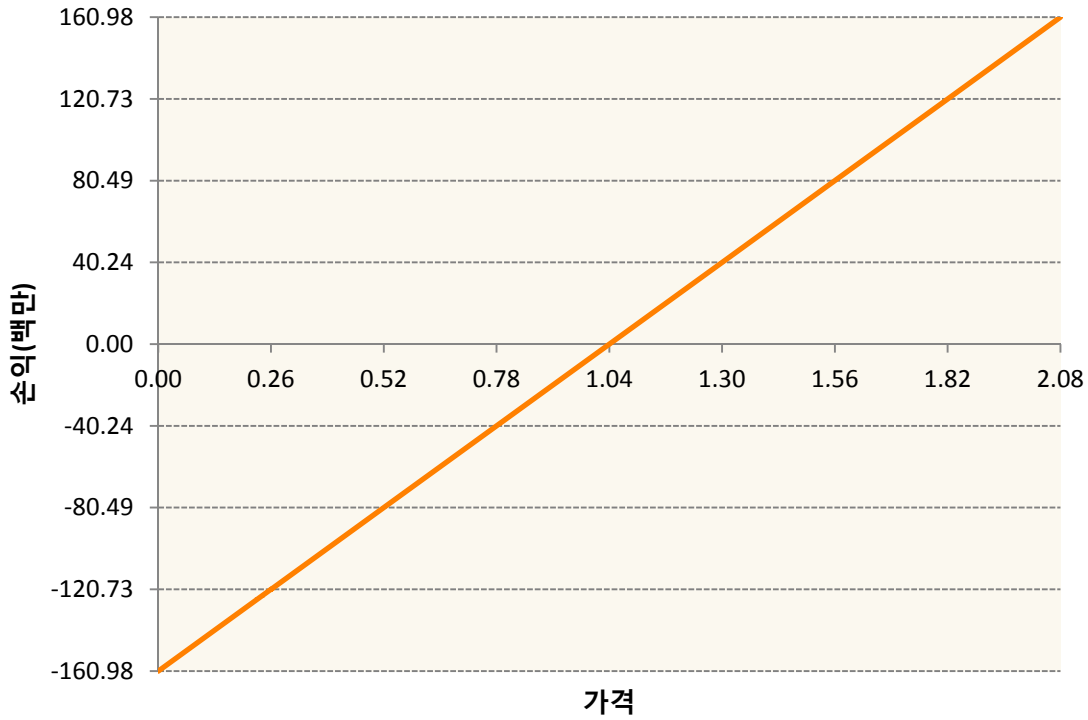
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20







XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| CLN0 | WTI CRUDE FUTURE Jul20 | 22 |
| COU0 | BRENT CRUDE FUTR Sep20 | 28 |
| HON0 | NY Harb ULSD Fut Jul20 | 9 |
| KR4175Q60C | 2020-06 달러선물 | 20 |
| NGN20 | NATURAL GAS FUTR Jul20 | 54 |
| QSN0 | Low Su Gasoil G Jul20 | 9 |
| XBN0 | GASOLINE RBOB FUT Jul20 | 13 |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

733

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-20 |
| 기준일 | 2020-05-19 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

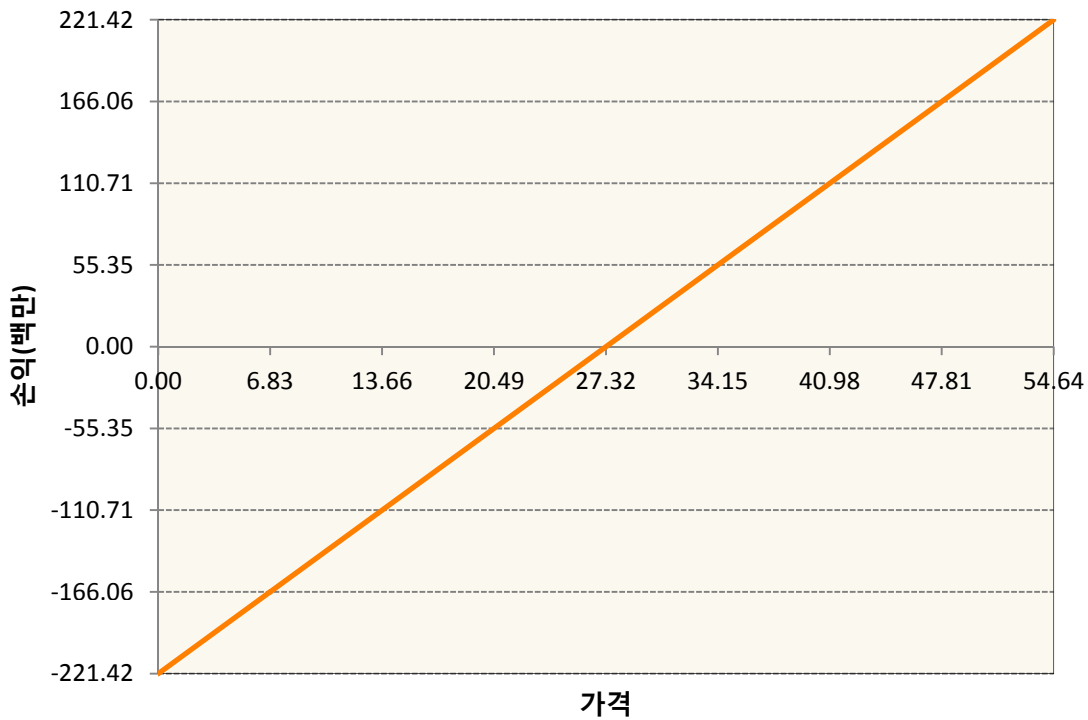
1. 계약금액

(단위:백만원)

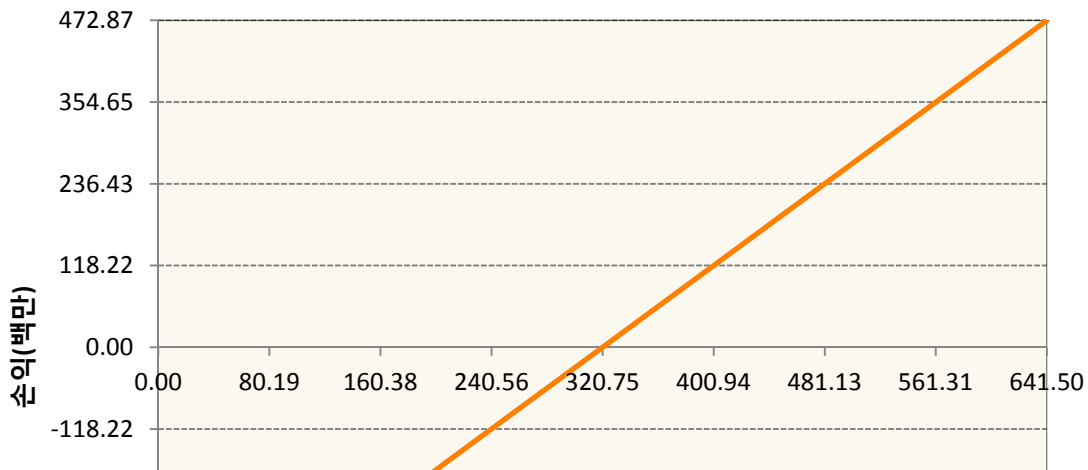
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,430 | 73 | 2,357 | |

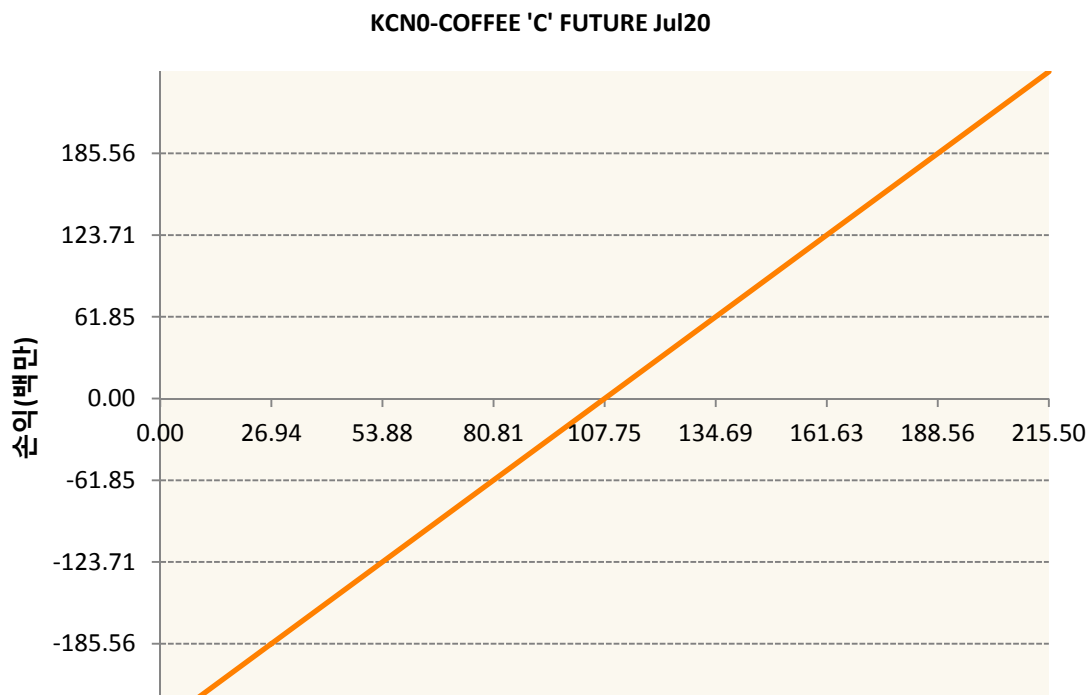
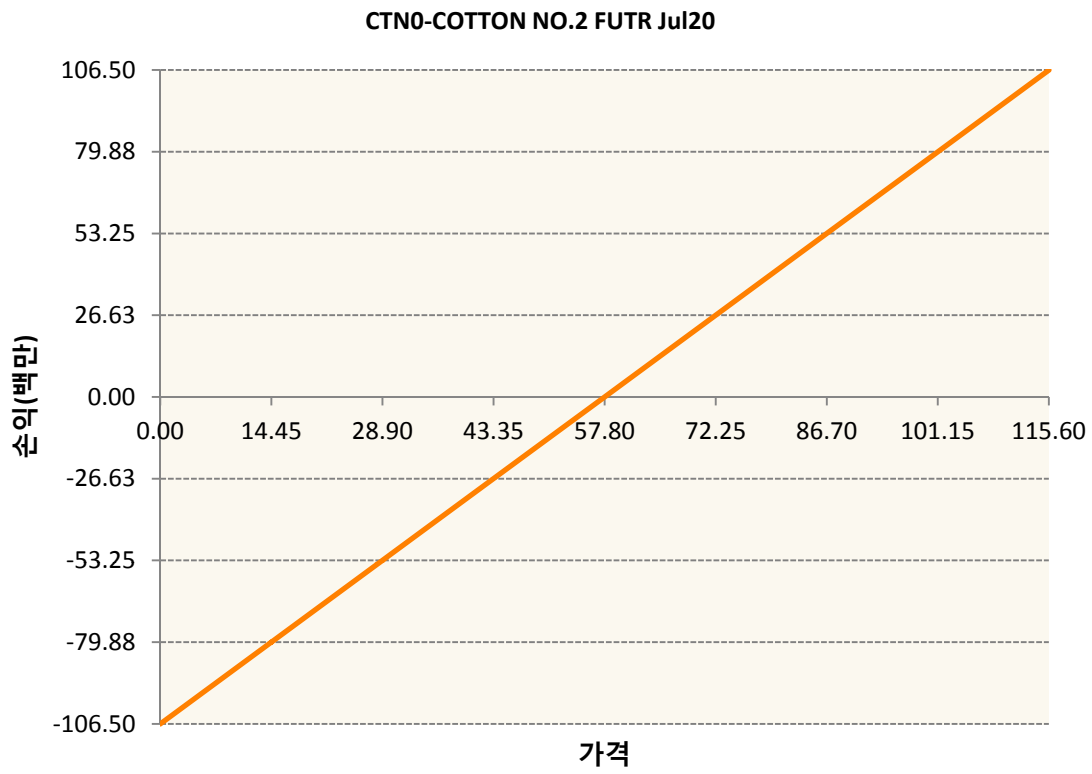
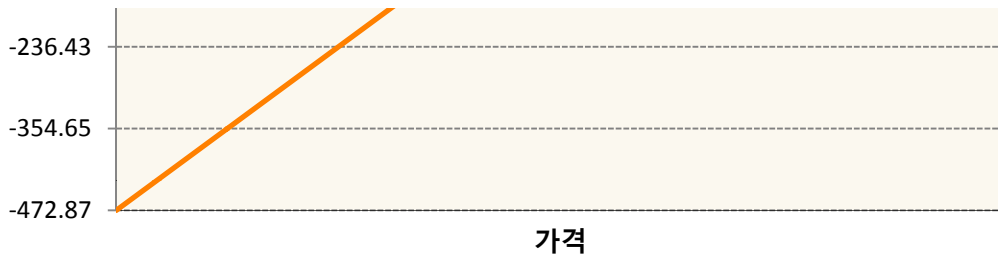
2. 만기시점의 손익구조

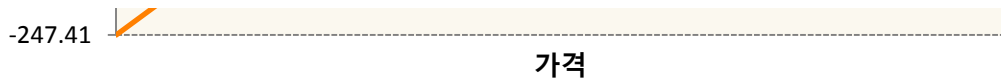
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



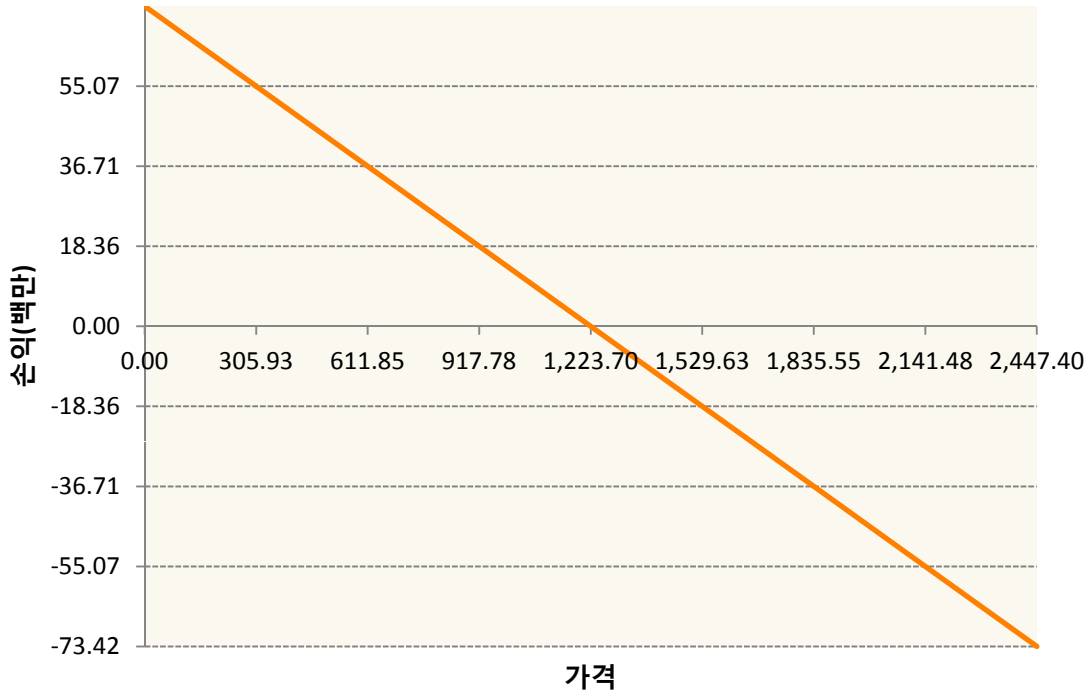
CN0-CORN FUTURE Jul20



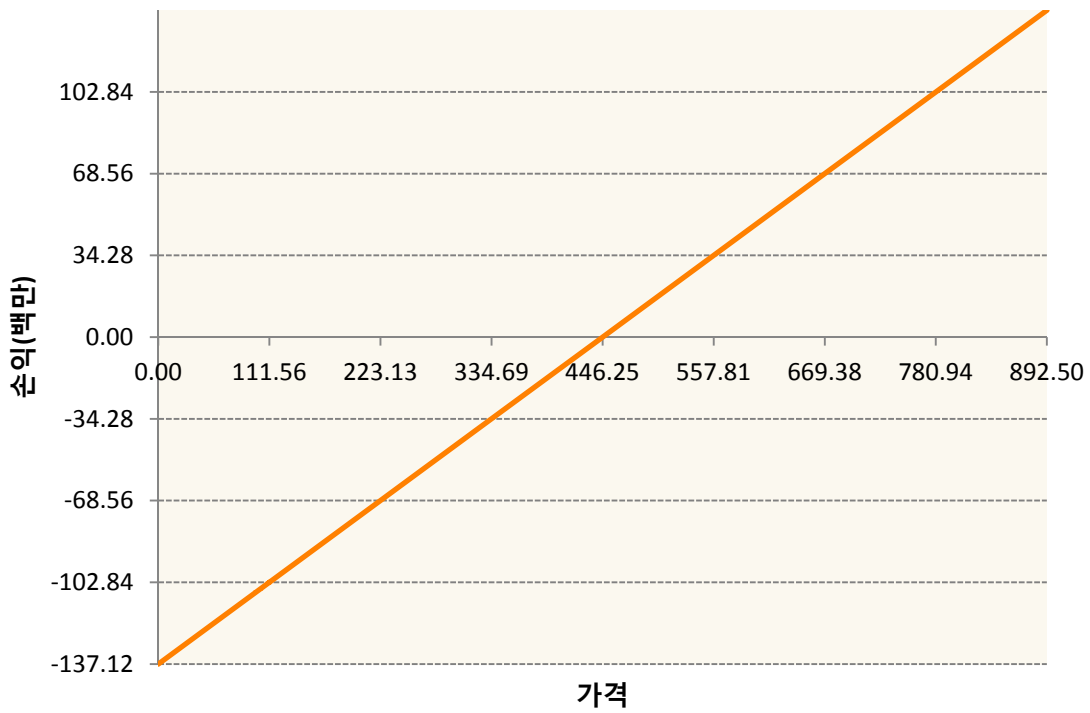




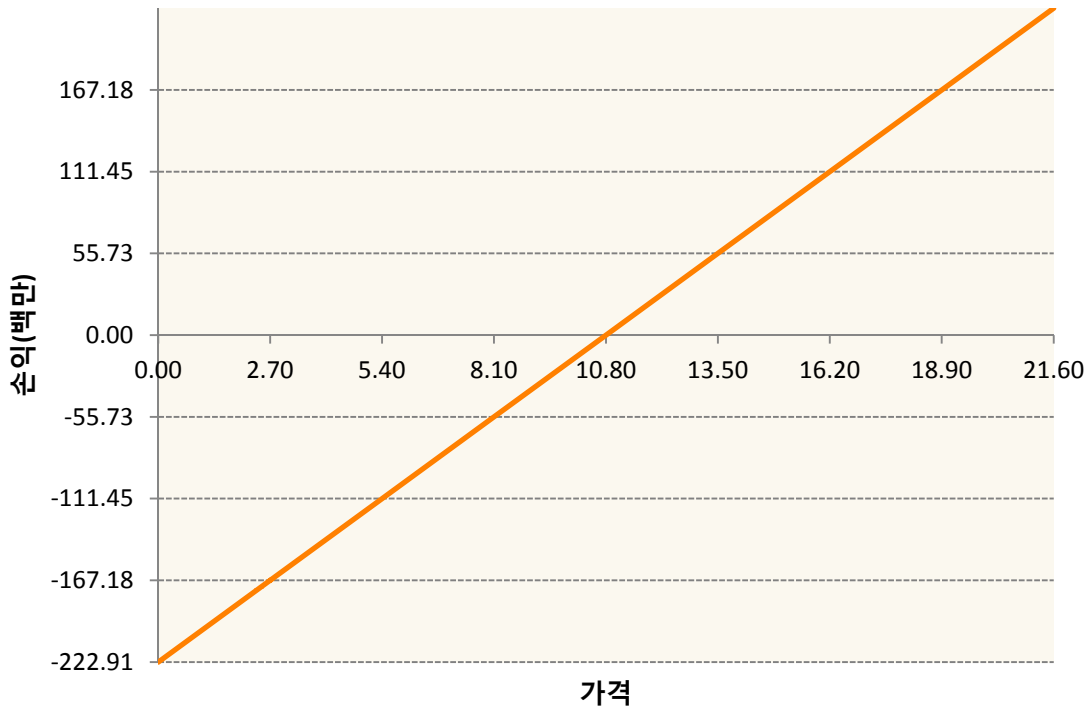
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



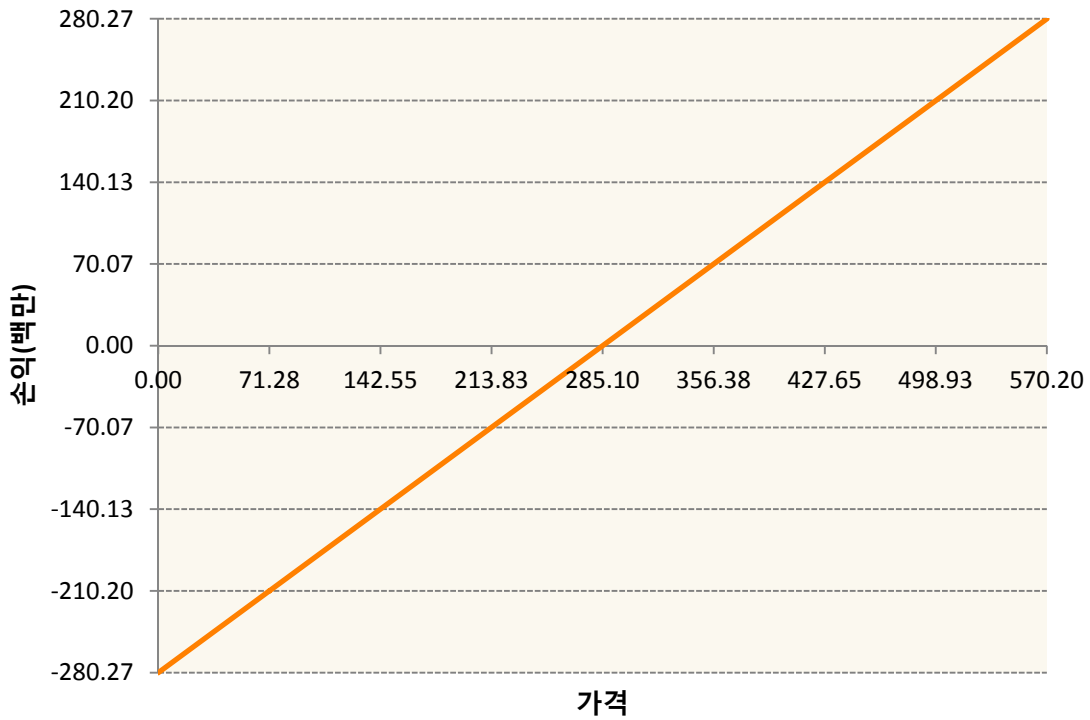
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



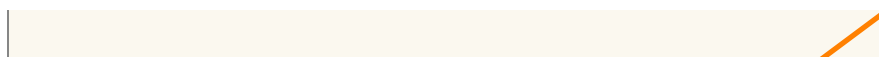
SBN0-Sugar Jul20

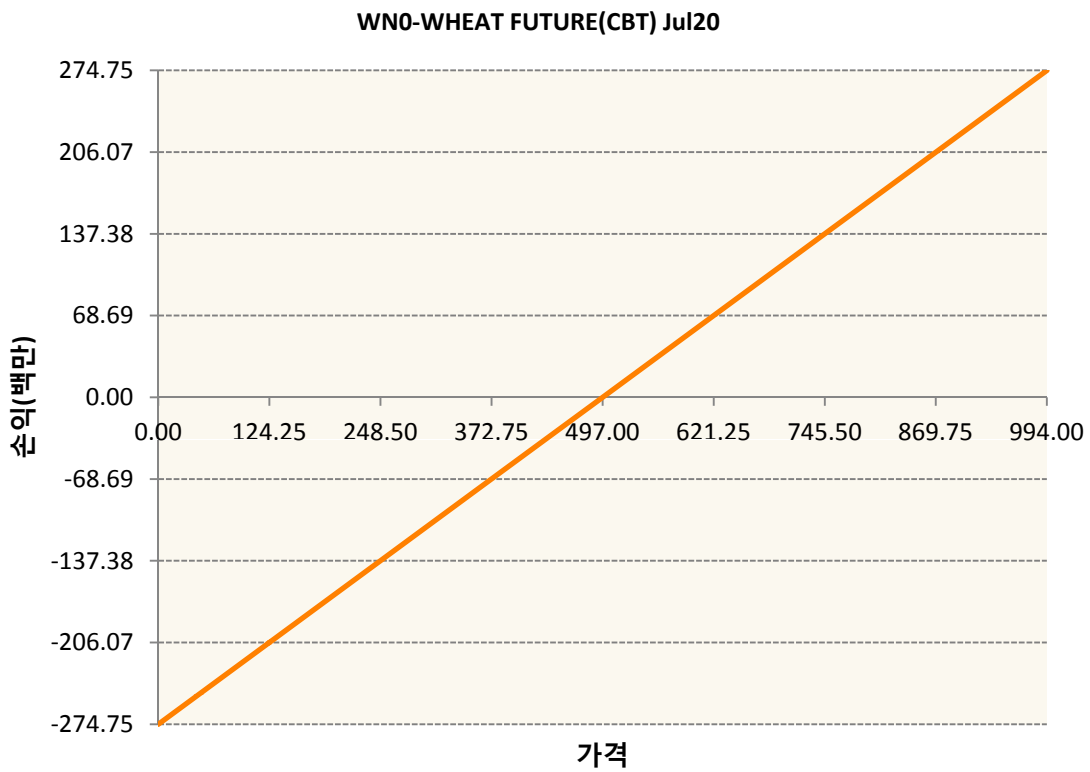
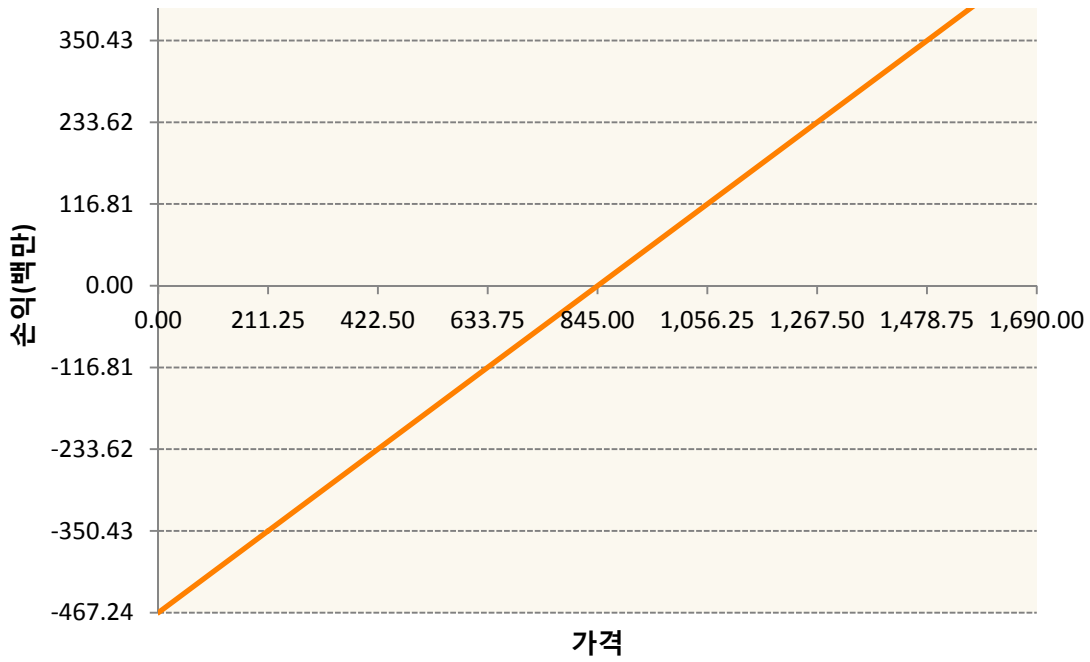


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| BON0 | SOYBEAN OIL FUTR Jul20 | 18 |
| CN0 | CORN FUTURE Jul20 | 38 |
| CTN0 | COTTON NO.2 FUTR Jul20 | 9 |
| KCN0 | COFFEE 'C' FUTURE Jul20 | 20 |
| KR4175Q60C | 2020-06 달러선물 | 6 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWN0 | KC HRW WHEAT FUT Jul20 | 11 |
| SBN0 | Sugar Jul20 | 18 |
| SMN0 | SOYBEAN MEAL FUTR Jul20 | 22 |
| SN0 | SOYBEAN FUTURE Jul20 | 37 |
| WNO | WHEAT FUTURE(CBT) Jul20 | 22 |

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

231